

淡江大學 1 1 1 學年度第 2 學期課程教學計畫表

課程名稱	期貨與選擇權	授課 教師	林建志 LIN, CHIEN-CHIN
	FUTURES AND OPTIONS		
開課系級	財金一碩專班 A	開課 資料	實體課程 選修 單學期 3學分
	TLBXJ1A		
課程與SDGs 關聯性	SDG4 優質教育 SDG8 尊嚴就業與經濟發展		
系 ( 所 ) 教育目標			
提供財務金融產業人才之專業訓練課程，以落實實務與理論融合應用之能力。			
本課程對應院、系(所)核心能力之項目與比重			
<p>A. 具備理論與實務融合應用之能力。(比重：30.00)</p> <p>B. 具備個案研究與分析的能力。(比重：25.00)</p> <p>C. 培養具備企業財務決策與分析之能力。(比重：15.00)</p> <p>D. 發展專業競爭的能力與態度。(比重：10.00)</p> <p>E. 提升財金研究理論與方法之素養。(比重：10.00)</p> <p>F. 提升考取高階財金專業證照之能力。(比重：10.00)</p>			
本課程對應校級基本素養之項目與比重			
<p>1. 全球視野。(比重：10.00)</p> <p>2. 資訊運用。(比重：20.00)</p> <p>3. 洞悉未來。(比重：5.00)</p> <p>4. 品德倫理。(比重：20.00)</p> <p>5. 獨立思考。(比重：30.00)</p> <p>6. 樂活健康。(比重：5.00)</p> <p>7. 團隊合作。(比重：5.00)</p> <p>8. 美學涵養。(比重：5.00)</p>			
課程簡介	<p>本課程主要在介紹衍生性商品市場及在市場中常見得金融工具(包括遠期、期貨、交換及選擇權)。主要目的在讓學生了解衍生性商品市場概況，各種衍生性金融工具在金融市場的重要性及套利、投機和避險的應用。讓修課學生了解衍生性商品的基本原理與市場交易實務狀況。</p>		

	The main purpose of this course is introduced the basic concept of the derivatives markets and the financial instruments used in this market. These instruments include the forwards, Futures , swaps and options. How to use these tools for arbitrage, speculative, and hedge is also an important object of this course.
--	---

本課程教學目標與認知、情意、技能目標之對應

將課程教學目標分別對應「認知 (Cognitive)」、「情意 (Affective)」與「技能(Psychomotor)」的各目標類型。

- 一、認知(Cognitive)：著重在該科目的事實、概念、程序、後設認知等各類知識之學習。
- 二、情意(Affective)：著重在該科目的興趣、倫理、態度、信念、價值觀等之學習。
- 三、技能(Psychomotor)：著重在該科目的肢體動作或技術操作之學習。

序號	教學目標(中文)	教學目標(英文)
1	衍生性商品交易與定價	Trading and Pricing of Derivatives

教學目標之目標類型、核心能力、基本素養教學方法與評量方式

序號	目標類型	院、系(所) 核心能力	校級 基本素養	教學方法	評量方式
1	認知	ABCDEF	12345678	講述、討論	測驗

授課進度表

週次	日期起訖	內容 (Subject/Topics)	備註
1	112/02/13~ 112/02/19	Introduction	
2	112/02/20~ 112/02/26	Mechanics of Futures Markets	
3	112/02/27~ 112/03/05	Hedging Strategies Using Futures	
4	112/03/06~ 112/03/12	Interest Rates	
5	112/03/13~ 112/03/19	Determination of Forward and Futures Prices	
6	112/03/20~ 112/03/26	Swaps	
7	112/03/27~ 112/04/02	Mechanics of Options Markets	
8	112/04/03~ 112/04/09	Properties of Stock Options	
9	112/04/10~ 112/04/16	Trading Strategies Involving Options	
10	112/04/17~ 112/04/23	Mid-term exam	
11	112/04/24~ 112/04/30	Introduction to Binomial Trees	

12	112/05/01~ 112/05/07	Valuing Stock Options: The Black-Scholes-Merton Model	
13	112/05/08~ 112/05/14	The Greek Letters	
14	112/05/15~ 112/05/21	Binomial Trees in Practice	
15	112/05/22~ 112/05/28	Volatility Smiles	
16	112/05/29~ 112/06/04	Value at Risk	
17	112/06/05~ 112/06/11	Credit Derivatives	
18	112/06/12~ 112/06/18	Final exam	
修課應 注意事項			
教學設備		電腦	
教科書與 教材		Fundamentals of Futures and Options Markets-John Hull	
參考文獻			
批改作業 篇數		篇 (本欄位僅適用於所授課程需批改作業之課程教師填寫)	
學期成績 計算方式		◆出席率： 10.0 %    ◆平時評量：        %    ◆期中評量：30.0 % ◆期末評量：40.0 % ◆其他〈課堂討論〉：20.0 %	
備 考		「教學計畫表管理系統」網址： <a href="https://info.ais.tku.edu.tw/csp">https://info.ais.tku.edu.tw/csp</a> 或由教務處 首頁→教務資訊「教學計畫表管理系統」進入。 <b>※不法影印是違法的行為。請使用正版教科書，勿不法影印他人著作，以免觸法。</b>	