

淡江大學 112 學年度第 1 學期課程教學計畫表

課程名稱	期貨與選擇權	授課 教師	(多位教師合開) 鄭婉秀 WAN-HSIU CHENG
	FUTURES AND OPTIONS		
開課系級	財金一碩士班 A	開課 資料	實體課程 選修 單學期 3學分
	TLBXM1A		
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			
以完整進階的財務金融課程，培養具獨立分析、判斷與解決問題的財務專業人才。			
本課程對應院、系(所)核心能力之項目與比重			
<p>A. 培養進階財務金融理論的知識。(比重：30.00)</p> <p>B. 提升應用理論與實務技巧。(比重：20.00)</p> <p>C. 加強邏輯推演的能力。(比重：10.00)</p> <p>D. 財金研究方法的學習與運用。(比重：10.00)</p> <p>E. 提升考取高階財金專業證照之能力。(比重：20.00)</p> <p>F. 具備學術未來深造的潛力。(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：5.00)</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：10.00)</p> <p>8. 美學涵養。(比重：5.00)</p>			
課程簡介	<p>在現今的金融市場中，衍生性商品早已普遍存在。本課程即是在介紹此領域，並將重心著重於三大證券資產：期貨、遠期契約及選擇權。課程目標在於瞭解(a)衍生性商品於風險管理上所扮演的角色，以及(b)衍生性商品的基本評價及避險原則。</p>		

Derivative securities have become ubiquitous in today's financial world. This course is an introduction to this field, and focuses in three particular classes of these securities: futures, forwards, and options. The objective is to understand (a) the role that can be played by derivatives securities in the management of risk, and (b) the general principals underlying the valuation and the hedging of derivative securities.

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	衍生性商品於風險管理上的角色扮演	The role played by derivatives in the management of risk.
2	衍生性商品的基本評價及避險原則	The general principals underlying the valuation and the hedging of derivative securities.

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	討論(含課堂、線上)、報告(含口頭、書面)
2	認知	ABCDEF	12345678	講述、討論	討論(含課堂、線上)、報告(含口頭、書面)

授課進度表

週次	日期起訖	內容 (Subject/Topics)	備註
1	112/09/11~ 112/09/17	Introduction	
2	112/09/18~ 112/09/24	Fundamental of futures markets	
3	112/09/25~ 112/10/01	Fundamental of futures markets	
4	112/10/02~ 112/10/08	Price discovery	
5	112/10/09~ 112/10/15	Price discovery	
6	112/10/16~ 112/10/22	Hedging	
7	112/10/23~ 112/10/29	Hedging	

8	112/10/30~ 112/11/05	Speculation	
9	112/11/06~ 112/11/12	Futures: Other topics	
10	112/11/13~ 112/11/19	Fundamental of option markets	
11	112/11/20~ 112/11/26	Price discovery	
12	112/11/27~ 112/12/03	Volatility smile	
13	112/12/04~ 112/12/10	Volatility	
14	112/12/11~ 112/12/17	Option: Other topics	
15	112/12/18~ 112/12/24	Option: Other topics	
16	112/12/25~ 112/12/31	Reports	
17	113/01/01~ 113/01/07	Reports	
18	113/01/08~ 113/01/14	自主學習-學術議題進階探究	
課程培養 關鍵能力	自主學習		
跨領域課程			
特色教學 課程			
課程 教授內容	邏輯思考 永續議題		
修課應 注意事項	Paper list及評分標準將於課堂上詳細說明。 每篇文章閱讀將安排兩組同學閱讀(主要報告20%/補充組10%) 期末評量30% = 期末自選報告		
教科書與 教材	自編教材:paper list		
參考文獻	Futures, Options, and Swaps, 5e, Kolb/Overdahl, 2007. (華泰) Options, Futures, and Other Derivatives, Hull. (雙葉)		
學期成績 計算方式	◆出席率： 5.0 %   ◆平時評量：30.0 %   ◆期中評量：30.0 % ◆期末評量：30.0 % ◆其他〈教學評量〉：5.0 %		

備考

「教學計畫表管理系統」網址：<https://info.ais.tku.edu.tw/csp> 或由教務處  
首頁→教務資訊「教學計畫表管理系統」進入。

**※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。**