

# 淡江大學114學年度第1學期課程教學計畫表

|   |   |      |                     |  |  |  |  |  |
|---|---|------|---------------------|--|--|--|--|--|
| 課程名稱  | 衍生性商品投資實務   | 授課教師 | 賴冠吉<br>LAI KUAN-CHI |  |  |  |  |  |
|   | DERIVATIVES:INVESTMENT PRACTICE                                 |      |                     |  |  |  |  |  |
| 開課系級  | 財金四P  | 開課資料 | 實體課程<br>選修 單學期 3學分  |  |  |  |  |  |
|   | TLBXB4P   |      |                     |  |  |  |  |  |
| 課程與SDGs<br>關聯性  | SDG1 消除貧窮<br>SDG3 良好健康和福祉<br>SDG4 優質教育<br>SDG8 尊嚴就業與經濟發展        |      |                     |  |  |  |  |  |
| 系(所)教育目標  |   |      |                     |  |  |  |  |  |
| 配合本校、院教育目標，因應國內外金融情勢的演變，培養財務金融理論與實務兼具的財務金融人才。   |   |      |                     |  |  |  |  |  |
| 本課程對應院、系(所)核心能力之項目與比重   |   |      |                     |  |  |  |  |  |
| A. 具備財務金融理論與實務的基本知識。(比重：35.00)<br>B. 加強相關金融法規的學習。(比重：10.00)<br>C. 培養財務金融職場的基本倫理與道德。(比重：10.00)<br>D. 提升學生的國際觀與外語能力。(比重：10.00)<br>E. 提升學生專業證照之能力。(比重：20.00)<br>F. 具備分析國內外金融發展情勢之基本能力。(比重：15.00) |   |      |                     |  |  |  |  |  |
| 本課程對應校級基本素養之項目與比重   |   |      |                     |  |  |  |  |  |
| 1. 全球視野。(比重：15.00)<br>2. 資訊運用。(比重：20.00)<br>3. 洞悉未來。(比重：15.00)<br>4. 品德倫理。(比重：5.00)<br>5. 獨立思考。(比重：30.00)<br>6. 樂活健康。(比重：5.00)<br>7. 團隊合作。(比重：5.00)<br>8. 美學涵養。(比重：5.00)                      |   |      |                     |  |  |  |  |  |
| 課程簡介  | 介紹各項衍生性金融商品的定價模型、價格行為、商品特性、風險以及策略交易。透過理論與實務的結合，達到了解各項衍生金融商品的運用。 |      |                     |  |  |  |  |  |

|  |  |
|--|--|
|  | Introduce the Derivative Financial Products,including pricing model,price behavior, risk, and strategic trading. By way of theory and practice, approach the purpose of understanding financial derivatives. |
|--|--|

### 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  | 介紹各項衍生性金融商品的定價模型、價格行為、商品特性、風險以及策略交易。透過理論與實務的結合，達到了了解各項衍生金融商品的運用。 | Introduce the Derivative Financial Products,including pricing model,price behavior, risk, and strategic trading. By way of theory and practice, approach the purpose of understanding financial derivatives. |
| 2  | 讓學生學習各種衍生性商品基本理論，透過市場實際資料，說明實務上如何操作交易各種衍生性商品。                    | Learn the basic theories of derivatives, how to use the market information to trade the derivatives in market.   |

### 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)<br>核心能力 | 校級<br>基本素養 | 教學方法  | 評量方式 |
|----|------|----------------|------------|-------|------|
| 1  | 認知   | ABCDEF         | 12345678   | 講述、模擬 | 測驗   |
| 2  | 技能   | ABCDEF         | 12345678   | 講述、模擬 | 測驗   |

### 授課進度表

| 週次 | 日期起訖                    | 內容 (Subject/Topics)   | 備註 |
|----|-------------------------|-----------------------|----|
| 1  | 114/09/15~<br>114/09/21 | 衍生性金融商品發展歷史           |    |
| 2  | 114/09/22~<br>114/09/28 | 衍生性金融商品理論基礎(一)        |    |
| 3  | 114/09/29~<br>114/10/05 | 外匯實務報價、換匯、Forward交易機制 |    |
| 4  | 114/10/06~<br>114/10/12 | 外匯實務報價、換匯、Forward交易機制 |    |
| 5  | 114/10/13~<br>114/10/19 | 期貨之各種交易策略與風險管理        |    |
| 6  | 114/10/20~<br>114/10/26 | 期貨與選擇權之造市機制與套利交易      |    |
| 7  | 114/10/27~<br>114/11/02 | 選擇權之各種交易策略、套利交易與風險管理  |    |
| 8  | 114/11/03~<br>114/11/09 | 選擇權之各種交易策略、套利交易與風險管理  |    |

|              |   |                      |  |
|--------------|---|----------------------|--|
| 9            | 114/11/10~114/11/16   | 期中考/期中評量週(老師得自行調整週次) |  |
| 10           | 114/11/17~114/11/23   | 認購售權證交易策略與風險管理       |  |
| 11           | 114/11/24~114/11/30   | 認購售權證交易策略與風險管理       |  |
| 12           | 114/12/01~114/12/07   | 轉換公司債之投資             |  |
| 13           | 114/12/08~114/12/14   | 轉換公司債套利交易與風險分析       |  |
| 14           | 114/12/15~114/12/21   | 資產交換定價、投資            |  |
| 15           | 114/12/22~114/12/28   | 資產交換交易策略與風險分析        |  |
| 16           | 114/12/29~115/01/04   | 期末多元評量週              |  |
| 17           | 115/01/05~115/01/11   | 期末多元評量週/教師彈性教學週      |  |
| 18           | 115/01/12~115/01/18   | 教師彈性教學週              |  |
| 課程培養<br>關鍵能力 | 資訊科技、問題解決、跨領域   |                      |  |
| 跨領域課程        | 素養導向課程(探索素養、永續素養或全球議題STEEP(Society , Technology, Economy, Environment, and Politics)) |                      |  |
| 特色教學<br>課程   | 專題/問題導向(PBL)課程  |                      |  |
| 課程<br>教授內容   | 智慧財產(課程內容教授智慧財產)<br>邏輯思考<br>A I 應用  |                      |  |
| 修課應<br>注意事項  |   |                      |  |
| 教科書與<br>教材   | 自編教材:講義<br>教材說明:<br>自行整理的教學講義<br>採用他人教材:教科書<br>教材說明:<br>投資學 作者： 邱文昌, 賴冠吉, 陳育欣         |                      |  |
| 參考文獻         | Options, Futures, and Other Derivatives (11th Edition) John C. Hull                   |                      |  |
| 學期成績<br>計算方式 | ◆出席率： 10.0 % ◆平時評量： % ◆期中評量： 45.0 %<br>◆期末評量： 45.0 %<br>◆其他 < > : %                   |                      |  |
|              |   |                      |  |

|     |   |
|-----|---|
| 備 考 | <p>「教學計畫表管理系統」網址：<a href="https://web2.ais.tku.edu.tw/csp">https://web2.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。</p> <p>※「遵守智慧財產權觀念」及「不得不法影印、下載及散布」。請使用正版教科書，勿不法影印他人著作，以免觸法。</p> |
|-----|---|