

淡江大學 98 學年度第 2 學期課程教學計畫表

課程名稱	(中) 選擇權				授課 教師	李沃牆
	(英) OPTIONS MARKET					
開課系級	(中) 財金三 C	開 課 資 料	<input checked="" type="checkbox"/> 必修	<input type="checkbox"/> 0 (單學期)	3 學 分	先修 科目
	(英) TBBXB3C		<input type="checkbox"/> 選修	<input type="checkbox"/> 1 (上學期) <input type="checkbox"/> 2 (下學期) <input type="checkbox"/> 3 (第3學期)		
學系教育目標			學生基本能力			
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。			A 具備財務金融理論與實務的基本知識。 B 加強相關金融法規的學習。 C 培養財務金融職場的基本倫理與道德。 D 提升學生的國際觀與外語能力。 E 提升學生專業證照之能力。 F 具有國際化、資訊化、未來化之願景規劃基本能力。 G 具備審視國內外金融發展情勢之基本能力。 H 培訓學生獨立、因應及解決問題的基本能力。			
課程簡介 (限50~100字)	(中) 讓修課學生能夠瞭解選擇權市場、選擇權商品及選擇權交易、避險。					
	(英) Let the students can understand the option market, options and option trading, hedging.					
本課程教學目標與學生基本能力相關性 一、目標層次(選填): 1 記憶、2 瞭解、3 應用、4 分析、5 評鑑、6 創造。 二、單項教學目標分別對應「目標層次」有多項時，僅填列最高層次項即可(例如:「目標層次」可對應 2、3 項時，僅取 3; 對應 3、5、6 項時僅取 6)。惟各項課程教學目標對應該系「學生基本能力」時，則可填列多項「學生基本能力」(例如: A、AD、BEF)。						
中文		英文		相關性		
				目標層次	學生基本能力	
1. 具備財務金融理論與實務的基本知識		1. With financial theory and practice knowledge		2	ADFG	
2. 增進對選擇權商品的瞭解		2. Advanced knowledge in options		2	ADFG	
3. 增進對選擇權的交易策略，避險策略的能力		3. Enhanced analytic capability in option trading strategies and hedging strategies.		4	AFGH	
課程目標之教學策略與評量方法						

課程目標	教學策略 (課堂講授、分組討論、參觀實習、其他)	評量方法 (出席率、報告、討論、小考、期中考、期末考、其他)
1 讓修課學生能夠瞭解選擇權商品	課堂講授、分組討論、參訪、虛擬交易	平時成績、 小組報告成績、 虛擬交易成績、 期中考、期末考
2、讓修課學生能夠瞭解選擇權交易策略	課堂講授、分組討論、參訪、虛擬交易、專題演講	平時成績、 小組報告成績、 虛擬交易成績、 期中考、期末考
3、讓修課學生能夠瞭解選擇權避險策略	課堂講授、分組討論、參訪、虛擬交易、專題演講	平時成績、 小組報告成績、 虛擬交易成績、 期中考、期末考

授 課 進 度 表

週次	內容 (Subject/Topics)	備註
1	1.Introduction to the course and Financial Engineering 2.Introduction to polaris simulation trading system	
2	1.Introduction to derivative (ch.1) 2.Introduction to option market(Taiwan, USA,....)	
3	An introduction to forwards and options-1(ch2)	
4	An introduction to forwards and options-2(ch2)	
5	Insurance , collars, and other strategies(ch3.1-3.2)	
6	Insurance , collars, and other strategies(ch3.3)	
7	Insurance , collars, and other strategies(ch3.4-3.5)	
8	Structured notes with options(ch12.3)	
9	Introduction to real options(ch14)	
10	Midterm	
11	The Black-Scholes formula-(ch11.1-11.2)	
12	The Black-Scholes formula-(ch11.3)	
13	The Black-Scholes formula-(ch11.4-11.5)	
14	Parity and other option relationships(ch9.1-9.2)	
15	Parity and other option relationships(ch9.3)	
16	Binomial option Pricing(Ch10.1-10.2)	
17	Binomial option Pricing(Ch10.4-10.5)	
18	Final Exam.	
教學設備	<input type="checkbox"/> 電腦 <input type="checkbox"/> 投影機 <input type="checkbox"/> 其他 (_____)	
教材課本	McDonal. R. L.(2009),Fundamental of Derivatives Markets, 雙葉書局代銷	

參考書籍	John Hull(2007),Option, Futures and Other Derivatives ,雙葉書局代銷 張傳章(2007):期貨與選擇權概論,雙葉書局出版 黃昱程 (2007):期貨與選擇權,華泰書局出版
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	<input type="checkbox"/> 平時成績：10 % <input type="checkbox"/> 期中考成績：30% <input type="checkbox"/> 期末考成績：20 % <input type="checkbox"/> 報告：20% <input type="checkbox"/> 其他 (<u>虛擬交易績效</u>)：20%
備考	教學計畫表上傳步驟：教務處首頁點選「教務資訊」→「教學計畫表上傳」；網址： http://ap09.emis.tku.edu.tw/ 。 ※非法影印是違法的行為。請使用正版教科書，勿非法影印他人著作，以免觸法。

表單編號：ATRX-Q03-001-FM201-02