

淡江大學 99 學年度第 2 學期課程教學計畫表

課程名稱	選擇權	授課 教師	姜義展 Chiang I Chan
	OPTIONS MARKET		
開課系級	財金進學班三A	開課 資料	必修 下學期 2學分
	TBBXE3A		
學系(門)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。			
學生基本能力			
<p>A. 具備財務金融理論與實務的基本知識。</p> <p>B. 加強相關金融法規的學習。</p> <p>C. 培養財務金融職場的基本倫理與道德。</p> <p>D. 提升學生的國際觀與外語能力。</p> <p>E. 提升學生專業證照之能力。</p> <p>F. 具有國際化、資訊化、未來化之願景規劃基本能力。</p> <p>G. 具備審視國內外金融發展情勢之基本能力。</p> <p>H. 培訓學生獨立、因應及解決問題的基本能力。</p>			
課程簡介	選擇權金融商品已經廣泛的應用於各項金融商品，在下學期的選擇權課程中，主要介紹相關實際選擇權的交易策略與模組應用，並且著重於選擇權應用的參數，Delta、Gamma、Theta、等五大參數應用與避險方式。		
	Option have been widely used in various financial products, the purpose of this course is that introduces the relevant option trading strategies and module applications, and focuses on the application of parameter options, Delta, Gamma, ... and other application of the five parameters and hedging methods.		

本課程教學目標與目標層級、學生基本能力相關性

一、目標層級(選填)：

- (一)「認知」(Cognitive 簡稱C)領域：C1 記憶、C2 瞭解、C3 應用、C4 分析、C5 評鑑、C6 創造
- (二)「技能」(Psychomotor 簡稱P)領域：P1 模仿、P2 機械反應、P3 獨立操作、P4 聯結操作、P5 自動化、P6 創作
- (三)「情意」(Affective 簡稱A)領域：A1 接受、A2 反應、A3 重視、A4 組織、A5 內化、A6 實踐

二、教學目標與「目標層級」、「學生基本能力」之相關性：

- (一)請先將課程教學目標分別對應前述之「認知」、「技能」與「情意」的各目標層級，惟單項教學目標僅能對應C、P、A其中一項。
- (二)若對應「目標層級」有1~6之多項時，僅填列最高層級即可(例如：認知「目標層級」對應為C3、C5、C6項時，只需填列C6即可，技能與情意目標層級亦同)。
- (三)再依據所訂各項教學目標分別對應該系「學生基本能力」。單項教學目標若對應「學生基本能力」有多項時，則可填列多項「學生基本能力」(例如：「學生基本能力」可對應A、AD、BEF時，則均填列)。

序號	教學目標(中文)	教學目標(英文)	相關性	
			目標層級	學生基本能力
1	學習基本理論，應用於實際交易	Basic theory, applied to the actual transaction	C3	ABCH

教學目標之教學策略與評量方法

序號	教學目標	教學策略	評量方法
1	學習基本理論，應用於實際交易	課堂講授、業界實務講座	出席率、期中考、期末考

授課進度表

週次	日期起訖	內容 (Subject/Topics)	備註
1	100/02/14~ 100/02/20	上學期複習	
2	100/02/21~ 100/02/27	選擇權策略介紹	
3	100/02/28~ 100/03/06	選擇權Excel應用(I)	
4	100/03/07~ 100/03/13	選擇權Excel應用(II)	
5	100/03/14~ 100/03/20	買、賣權價差組合，實際損益計算、Excel設計	
6	100/03/21~ 100/03/27	買、賣權價差組合，實際損益計算、Excel設計(II)	
7	100/03/28~ 100/04/03	買、賣權蝶式與禿鷹價差組合，實際損益計算、Excel設計(I)	
8	100/04/04~ 100/04/10	買、賣權蝶式與禿鷹價差組合，實際損益計算、Excel設計(II)	
9	100/04/11~ 100/04/17	選擇權跨期間垂直價差策略組合	

10	100/04/18~ 100/04/24	期中考試週	
11	100/04/25~ 100/05/01	Delta、Gamma參數介紹	
12	100/05/02~ 100/05/08	Delta、Gamma風險中立組合	
13	100/05/09~ 100/05/15	Vega、Theta、Rho參數介紹	
14	100/05/16~ 100/05/22	Vega、Theta、Rho風險中立組合	
15	100/05/23~ 100/05/29	GreekS 影響選擇權價格分析匯整	
16	100/05/30~ 100/06/05	業界實務操作分享課程	
17	100/06/06~ 100/06/12	新奇選擇權	
18	100/06/13~ 100/06/19	期末考試週	
修課應 注意事項	上課將配合Excel教學		
教學設備	電腦、投影機		
教材課本	課堂板書與投影片		
參考書籍			
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	◆平時考成績：20.0 % ◆期中考成績：40.0 % ◆期末考成績：40.0 % ◆作業成績： % ◆其他〈 〉： %		
備 考	「教學計畫表管理系統」網址： http://info.ais.tku.edu.tw/csp 或由教務處 首頁〈網址： http://www.acad.tku.edu.tw/index.asp/ 〉教務資訊「教學計畫 表管理系統」進入。 ※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。		