

淡江大學 99 學年度第 2 學期課程教學計畫表

課程名稱	證券暨期貨交易個案研究	授課 教師	賴冠吉 Lai Kuan-chi
	CASE STUDY ON SECURITY AND FUTURES TRADING		
開課系級	財金在職班四 A	開課 資料	選修 單學期 2學分
	TBBXK4A		
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	<p>本課程之目的是讓同學能透過實務的操作實例與教學方式，了解如何投資及交易股票與期貨，同時也透過一些財務工程的方法與電腦系統分析並建立出一套策略交易的流程，實際了解資本市場的運作。</p>		
	<p>The purpose of current course is using practical example and teaching method to let students learn to invest and trade equity and futures. And by way of Financial Engineering and computer system students can analysis and make the procedures of strategic trading, realize the practice of capital market.</p>		

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	1 學生將能夠歸納課程中介紹到的概念，包含下列主題：金融市場的發展，股票，基本面分析，技術面分析，投資流程，期貨選擇權，避險機制，風險管理，投資情緒管理等。	1 Students will be able to summarize concepts covered in the following topics: Development of Financial Market , Equity , Fundamental Analysis, Technical Analysis, Investment Process ,Future/Option, Hedging Process , Risk Management and Investment Psychology Management .	C2	ABCD
2	2 學生將能夠對於各項投資方法與觀念，了解真正的理由與應用。例如：基本面選股原則、技術面指標原理、選股邏輯與程序、投資配置、風險管理。	2 Students will be able to understand the true reason and application of investment method. The issues are such as: Selection Principal of Fundamental, Principal of Technical Indicator, Selection logic and procedure, asset allocation, and risk management.	C4	ABC
3	3 學生將能夠透過實際投資個案的各種流程發現如何做好投資規劃與管理，對於教學(者)、學習(者)、真正投資邏輯與流程等的思考方向與意涵。	3 Students will be able to discover how to make the investment plan and management, what true investment logic and procedure for teaching, learning, and literacy development	C3	ABC

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	1學生將能夠歸納課程中介紹到的概念，包含下列主題：金融市場的發展，股票，基本面分析，技術面分析，投資流程，期貨選擇權，避險機制，風險管理，投資情緒管理等。	課堂講授	期中考
2	2學生將能夠對於各項投資方法與觀念，了解真正的理由與應用。例如：基本面選股原則、技術面指標原理、選股邏輯與程序、投資配置、風險管理。	課堂講授	期中考
3	3學生將能夠透過實際投資個案的各種流程發現如何做好投資規劃與管理，對於教學(者)、學習(者)、真正投資邏輯與流程等的思考方向與意涵。	課堂講授	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	課程簡介 / 資本市場簡介	
2	100/02/21~ 100/02/27	單元一：金融商品發展與市場結構(商品介紹與結構)	
3	100/02/28~ 100/03/06	單元一：股票 (為何有股票、市場意義、股票市場基本運作)	
4	100/03/07~ 100/03/13	單元二：基本面分析 (產業結構分析)	
5	100/03/14~ 100/03/20	單元二：基本面分析 (財務三表分析)	
6	100/03/21~ 100/03/27	單元二：基本面分析 (價值投資原則，評價模型建構)	
7	100/03/28~ 100/04/03	單元二：基本面分析 (營收成長投資原則，評價模型建構)	
8	100/04/04~ 100/04/10	單元三：技術面分析 (基本指標原理)	
9	100/04/11~ 100/04/17	單元三：技術面分析 (分析原則，指標模型建構)	
10	100/04/18~ 100/04/24	期中考試週	
11	100/04/25~ 100/05/01	單元四：股票選股邏輯(基本面、技術面與籌碼面整合)	
12	100/05/02~ 100/05/08	單元四：股票投資程序 (分析、決定、執行、檢討)	
13	100/05/09~ 100/05/15	單元五：期貨選擇權 (基本概念與市場概況)	
14	100/05/16~ 100/05/22	單元五：期貨選擇權 (操作邏輯、策略應用)	
15	100/05/23~ 100/05/29	單元五：期貨選擇權 (避險機制、套利交易)	
16	100/05/30~ 100/06/05	單元六：風險管理 (基本觀念、VaR)	
17	100/06/06~ 100/06/12	單元六：風險管理 (各項風險評量、執行程序)	

18	100/06/13~ 100/06/19	期末考試週	
修課應 注意事項			
教學設備	電腦、投影機		
教材課本			
參考書籍	1.巴菲特法則,巴菲特,聯經出版社,李芳齡譯,92年。 2.笑傲股市,威廉歐尼爾,麥格羅希爾出版社,98年。 3.Options, Futures, and Other Derivatives, 7th Edition NEW May 2008		
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：10.0 %   ◆期中考成績：40.0 %   ◆期末考成績：50.0 % ◆作業成績：            % ◆其他〈 〉：            %		
備 考	「教學計畫表管理系統」網址： <a href="http://info.ais.tku.edu.tw/csp">http://info.ais.tku.edu.tw/csp</a> 或由教務處 首頁〈網址： <a href="http://www.acad.tku.edu.tw/index.asp/">http://www.acad.tku.edu.tw/index.asp/</a> 〉教務資訊「教學計畫 表管理系統」進入。 <b>※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。</b>		