

100-2 大葉大學 完整版課綱

基本資訊

課程名稱	期貨與選擇權	科目序號 / 代號	1071 / FBM4001
開課系所	財務金融學系	學制 / 班級	大學日間部3年1班
任課教師	賴奕豪	專兼任別	專任
必選修 / 學分數	必修 / 3	畢業班 / 非畢業班	非畢業班
上課時段 / 地點	(一)234 / H445	授課語言別	中文

課程簡介

A.管理學院SQ (Society Quotient ; 社會智商) 核心能力之四大構面(SCEP) :

- 1.S-解決問題能力 (洞析力、決策力、執行力)
- 2.C-溝通能力 (傾聽能力、表達能力)
- 3.E-倫理觀 (社會倫理、企業倫理、研究倫理)
- 4.P-專業能力 (管理能力-強調商管知識與技能、 研究能力-強調商管研究專業)

B.財務金融系之教育目標 :

- 1.厚植學生職場競爭力
- 2.增進學生責任感與倫理觀

C.財務金融系之核心能力(WE CARE) :

- 1.具備職場專業財金技能(W) 50%
- 2.擁有探索與解決問題的能力(E) 15%
- 3.具有財金資訊蒐集與分析能力(CA) 25%
- 4.具備責任感與倫理素養(RE) 10%

D.本課程描述 :

近年來，期貨與選擇權市場日益蓬勃發展，儼然成為傳統投資工具外的熱門金融商品。然而其高風險與高報酬的特性，讓不得其門而入的投資人望之卻步。本課程即針對國內、外期貨與選擇權市場作一概述，分別介紹歷史沿革與發展。深入淺出講解期貨與選擇權評價方式與交易策略，並針對部分避險議題進行較深入的探討，使同學具備職場專業財金技能。

本課程亦將配合TEJ與Datastream等資料庫與「虛擬交易所」的使用，讓同學主動關心相關商品的資訊，據以分析並進行模擬投資，讓學生培養學生財金資訊蒐集與分析能力。

此外，透過i-course線上學習平台，將規劃一系列相關主題進行小組討論與作業，透過線上討論方式，讓學生能主動探索與解決問題。

本課程將舉行校外參訪，讓同學了解實際職場操作環境並建立同學職場正確觀念。

本課程上課內容以輔導考取「期貨商業務員」證照為主軸。希望同學在修習過程中，能同時準備證照考試

, 並以期末順利取得證照為目標。

課程大綱

本課程著重培育證券期貨專業相關能力，課程主要培養財金系學生具有期貨與選擇權基本觀念、工具及技術與未來發展專業能力。

依財金系WE CARE之核心能力配分標準，本課程教學內容於培育各項核心能力之比重如下：

1. 具備職場專業財金技能(W) 50%
2. 擁有探索與解決問題的能力(E) 15%
3. 具有財金資訊蒐集與分析能力(CA) 25%
4. 具備責任感與倫理素養(RE) 10%

考照分析與期貨簡介

結算制度、下單實務與保證金計算

各類期貨評價

價差與避險交易策略

選擇權簡介





選擇權評價

選擇權交易策略

基本能力或先修課程

金融市場、投資學、財務管理、經濟學

課程與系所基本素養及核心能力之關連

-  具備職場專業財金技能
-  擁有探索與解決問題的能力
-  具有財金資訊蒐集與分析能力
-  具備責任感與倫理素養

教學計畫表

系所核心能力	權重(%) 【A】	檢核能力指標(績效指 標)	教學策略	評量方法及配分 權重	核心能力 學習成績 【B】	期末學習 成績 【C=B*A 】
--------	--------------	------------------	------	---------------	---------------------	---------------------------

具備職場專業財金技能	50%	商管基礎知識 財富規劃與投資 財金實務技能 國際視野	講述法 校外參訪 實務操作(實驗、上機或實習等) 專題報告	小考: 10% 課程參與度: 20% 成品製作: 20% 書面報告: 50%	加總: 100	50
擁有探索與解決問題的能力	15%	團隊合作 創新思考 主動探索與解決問題 人際關係與溝通	講述法 校外參訪 實務操作(實驗、上機或實習等) 專題報告	小考: 10% 課程參與度: 20% 成品製作: 20% 書面報告: 50%	加總: 100	15
具有財金資訊蒐集與分析能力	25%	邏輯推理能力 金融情勢分析 資料收集與整合應用	講述法 校外參訪 實務操作(實驗、上機或實習等) 專題報告	小考: 10% 課程參與度: 20% 成品製作: 20% 書面報告: 50%	加總: 100	25
具備責任感與倫理素養	10%	責任感 財金倫理 社會關懷	講述法 校外參訪 實務操作(實驗、上機或實習等) 專題報告	小考: 10% 課程參與度: 20% 成品製作: 20% 書面報告: 50%	加總: 100	10

成績稽核

書面報告: 50%
成品製作: 20%
課程參與度: 20%
小考: 10%

教科書(尊重智慧財產權，請用正版教科書，勿非法影印他人著作)

書名	作者	譯者	出版社	出版年
期貨與選擇權 - 策略 型交易與套利實務	廖四郎、王昭文	無	新陸書局	2010

參考教材及專業期刊導讀(尊重智慧財產權，請用正版教科書，勿非法影印他人著作)

書名	作者	譯者	出版社	出版年
----	----	----	-----	-----

無參考教材及專業期刊導讀

上課進度		分配時數(%)				
週次	教學內容	講授	示範	習作	實驗	其他
1	考照分析與期貨簡介	100				
2	期貨市場發展之沿革、功能與現況	100				
3	結算制度、下單實務與保證金計算	100				
4	結算制度、下單實務與保證金計算	100				
5	各類期貨評價	100				
6	價差與避險交易策略	100				
7	價差與避險交易策略	100				
8	期中考	100				
9	選擇權簡介	100				
10	選擇權評價	100				
11	選擇權評價	100				
12	選擇權初階交易策略	100				
13	選擇權初階交易策略	100				
14	選擇權進階交易策略	100				
15	選擇權進階交易策略	100				
16	其他相關主題(如參訪)	100				
17	期末考	100				
18	期末考	100				