

開南大學 96 年度第 2 學期財務金融學系、所、中心科目教學計劃表

課程編號	1 2 5 0 M 1 2 3 0	授課教師：王睦舜 老師
班次	財金碩士班	<input type="checkbox"/> 必修 老師 e-mail : raffinwang@knu.edu.tw
開課系所：	財務金融學系	<input type="checkbox"/> 選修 老師分機：6123
年級班別：	一年 班	
課程名稱(中文)	學分數	課程名稱(英文)
衍生性金融商品	3	Options, futures and other derivatives
教學目標與內容	This course covers options, forward contracts, futures contracts, and swaps. By the end of the course you will have a good knowledge of how these contracts work, how they are used, and how they are priced. Individuals who are skilled at analyzing derivatives are in great demand in New York, London and other financial centers throughout the world. If successful, they can command very high salaries within a few years of graduating.	
實施方法	<input type="checkbox"/> 講解法_ <input type="checkbox"/> 討論法	
評量方式	出席 20%(含參予作業討論),作業(20%),期中與期末考各 30%	
授課使用及參考書籍	(請按作者、書名、版別、出版商、發行地、出版年份、起訖頁數順序填寫)。 John, C., Hull, Options, Futures, and Other Derivatives	
科目簡介(含課程大綱及教學進度)：		
課程之規劃如下：		
<ol style="list-style-type: none"> 1. 於應繳作業週,同學應就教師所勾選之作業進行報告,如 3/20 報告 p.18 第一章 26 到 28 題,自行安排分配,一人報告一題,依次 13 人輪流報告 2. 作業報告應於前一日繳交,老師審閱後,如未通過者,則扣一點,全學期有三次扣點則不予及格 3. 因報告不及格者不予補考,若非為報告不及格所致之不及格,係兩次考試分數太低者,將於 6/27 以後以電子信箱通知於 7/3 來校補考,若補考未過則不予及格 4. 三次以上缺課未到者,不予及格 		

Date	Schedule	Exercise	remark
3/6	Curricular introducing		
3/13	Introduction; Chapters 1		
3/20	Futures markets, Chapter 2 Hedging Strategies Using Futures, Chapter 3 Interest Rates, Chapter 4	1.26-28(p.18)	一人一題
3/27	Determination of Forward and Futures Prices, Chapter 5	2.23、2.27、2.29、 3.23、3.25、4.27	一人一題
4/3	Interest Rate Futures, Chapter 6	5.24-5.28	一人一題
4/10	Swaps, Chapter 7	6.23-6.26	一人一題
4/17	期中考		
4/24	Properties of Options, Chapters 8 and 9		
5/1	Trading Strategies and Binomial Trees, Chapter 10 and 11	8.23-8.26;9.22-9.2 6	一人一題
5/8	Wiener process chapter12	10.21、11.19	一人一題
5/15	Pricing of Stock Options, Chapter 13 (excl Section 13.6)		一人一題
5/22	Options on Stock Indices, Currencies, and Futures, Chapters 14	13.27-13.30	一人一題
5/29	The Greeks, Chapters 15	14.40-42	一人一題
6/5	Volatility Smiles, Chapter 16	15.28-15.30	一人一題
6/12	Basic numeric procedures, Chapter 17		
6/19	調課:VAR chapter 18		
6/26	期末考		
7/3	補考		

說明：

- 授課教師於學期前填寫本表，經課程委員會審核後，影印分送給教師所屬課程委員會召集人，授課班級所屬系、所及教務處課務組；並於開始上課時，將本內容向學生說明。
- 本表於 91.4.23 第四次校課程委員會討論通過。

課程委員會召集人

財金系
主任 何文榮

授課教師：

課務組
辦事員 郭惠姍

課務組
97.3.7
收文章