

淡江大學 100 學年度第 1 學期課程教學計畫表

課程名稱	利率衍生商品	授課 教師	林蒼祥 Lin William T.
	INTEREST RATE DERIVATIVES		
開課系級	財金一碩士班 A	開課 資料	必修 單學期 3學分
	TBBMM1A		
系 所 教 育 目 標			
以完整進階的財務金融課程，培養具獨立分析、判斷與解決問題的財務專業人才。			
系 所 核 心 能 力			
A. 培養進階財務金融理論的知識。 B. 提升應用理論與實務技巧。 C. 加強邏輯推演的能力。 D. 財金研究方法的學習與運用。 E. 提升考取高階財金專業證照之能力。 F. 具備學術未來深造的潛力。			
課程簡介	進一步介紹現今主要之金融資產以及衍生性商品，並藉由定價模型與公式的推導，讓學生了解模型與參數背後之財務意涵，並提升學生對公式之理論與實務上之應用		
	This course provides students an advenced comprehension of financial assets and derivatives. Make students understand the meanings of financial products by deriving pricing models, promoting students' ability of application in theoretical and practical.		

本課程教學目標與目標層級、系所核心能力相關性

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」、「系所核心能力」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「系所核心能力」。單項教學目標若對應「系所核心能力」有多項時，則可填列多項「系所核心能力」(例如：「系所核心能力」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	系所核心能力
1	具備財務風險管理理論與實務的基本知識	With financial risk theory and practice knowledge	C2	ABCD
2	增進風險管理的知識	Advanced knowledge in risk management	C2	AD
3	增進對市場風險，信用風險，作業風險的分析能力	Enhanced analytic capability in market risk, credit risk and operational risk	P3	ABCD

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	具備財務風險管理理論與實務的基本知識	課堂講授、分組討論	出席率、報告、討論
2	增進風險管理的知識	課堂講授、分組討論	出席率、討論
3	增進對市場風險，信用風險，作業風險的分析能力	課堂講授、分組討論	出席率、討論

本課程之設計與教學已融入下列本校基本素養與核心能力

淡江大學基本素養與核心能力	內涵說明
◇ 表達能力與人際溝通	有效運用中、外文進行表達，能發揮合作精神，與他人共同和諧生活、工作及相處。
◆ 科技應用與資訊處理	正確、安全、有效運用資訊科技，並能蒐集、分析、統整與運用資訊。
◆ 洞察未來與永續發展	能前瞻社會、科技、經濟、環境、政治等發展的未來，發展與實踐永續經營環境的規劃或行動。
◇ 學習文化與理解國際	具備因應多元化生活的文化素養，面對國際問題和機會，能有效適應和回應的全球意識與素養。
◆ 自我了解與主動學習	充分了解自我，管理自我的學習，積極發展自我多元的興趣和能力，培養終身學習的價值觀。
◆ 主動探索與問題解決	主動觀察和發掘、分析問題、蒐集資料，能運用所學不畏挫折，以有效解決問題。
◇ 團隊合作與公民實踐	具備同情心、正義感，積極關懷社會，參與民主運作，能規劃與組織活動，履行公民責任。
◇ 專業發展與職涯規劃	掌握職場變遷所需之專業基礎知能，管理個人職涯的職業倫理、心智、體能和性向。

授 課 進 度 表

週次	日期起訖	內 容 (Subject/Topics)	備 註
1	100/09/05~ 100/09/11	固定收益証券與財富管理市場簡介	
2	100/09/12~ 100/09/18	債卷與利率換算:Chap.4	
3	100/09/19~ 100/09/25	期貨持有成本模型,交割結算及避險:Chap.3,個案一	
4	100/09/26~ 100/10/02	利率期貨:Chap.10	
5	100/10/03~ 100/10/09	選擇權市場簡介:Chap.9	
6	100/10/10~ 100/10/16	股價變動模型及Stochastic Calculus	
7	100/10/17~ 100/10/23	ITO處理 Lognormal:Chap.12,個案二	
8	100/10/24~ 100/10/30	ITO處理 Lognormal:Chap.12,個案二	
9	100/10/31~ 100/11/06	期中考	
10	100/11/07~ 100/11/13	無套利機會及The B-S modal:Chap.13,個案三	
11	100/11/14~ 100/11/20	歐式選擇權,選擇公式及美式個股機率選擇近似解:Chap.13, Chap.14	
12	100/11/21~ 100/11/27	Swaps: Chap.7	

13	100/11/28~ 100/12/04	利率模型及利率選擇權公式:Chap.26	
14	100/12/05~ 100/12/11	Martingales:Chap.25	
15	100/12/12~ 100/12/18	凹度及Quanto(跨貨幣)調整:Martingales應用一,Chap.27	
16	100/12/19~ 100/12/25	參觀期交所:期貨與選擇權交易模擬教室	
17	100/12/26~ 101/01/01	凹度及Quanto(跨貨幣)調整:Martingales應用二,Chap.27	
18	101/01/02~ 101/01/08	期末考試週	
修課應 注意事項			
教學設備		(無)	
教材課本		Hull, J.(2006) "Options, Futures and other Derivatives", 6th ed.(雙葉代理)	
參考書籍		Fabozzi(翻譯本) "Fixed Income Securities " (寰宇出版)	
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		◆平時考成績： % ◆期中考成績：45.0 % ◆期末考成績：45.0 % ◆作業成績： % ◆其他〈平時成績〉：10.0 %	
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。	