

淡江大學 101 學年度第 1 學期課程教學計畫表

課程名稱	衍生性商品研討	授課 教師	盧陽正 YANG CHENG LU
	SEMINAR ON DERIVATIVES		
開課系級	財金一博士班 A	開課 資料	選修 單學期 3學分
	TLBXD1A		
系 (所) 教育目標			
紮實的財務理論基礎與嚴謹的研究方法，培養具國際視野與獨立研究能力之學術人才。			
系 (所) 核心能力			
<p>A. 奠定紮實的財務金融理論基礎。</p> <p>B. 整合跨領域理論與實務的應用能力。</p> <p>C. 熟稔相關財金研究方法與成果。</p> <p>D. 具備獨立研究的學術能力。</p> <p>E. 提升學生的教學能力。</p> <p>F. 提升學術研究國際化之能力。</p>			
課程簡介	藉由探討衍生性金融商品(期貨、選擇權與利率交換契約等)的結構，進一步增加關於訂價模式、避險及其他應用策略的分析知識與技術。		
	The futures, options, swaps and other derivative securities will be discussed in this course. Pricing, hedging and other application of these derivative securities will be analyzed.		

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其「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	1.具備財務風險管理理論與實務的基本知識	1.With financial risk theory and practice knowledge	C2	ABCD
2	2.增進風險管理的知識	2.Advanced knowledge in risk management	C2	AD
3	3.增進對市場風險，信用風險，作業風險的分析能力	3.Enhanced analytic capability in market risk, credit risk and operational risk	P3	ABCD

教學目標之教學方法與評量方法

序號	教學目標	教學方法	評量方法
1	1.具備財務風險管理理論與實務的基本知識	講述、討論	報告、上課表現、出席率
2	2.增進風險管理的知識	講述、討論	報告、上課表現、出席率
3	3.增進對市場風險，信用風險，作業風險的分析能力	講述、討論	報告、上課表現、出席率

本課程之設計與教學已融入本校校級基本素養

淡江大學校級基本素養	內涵說明
◆ 全球視野	
◆ 洞悉未來	
◇ 資訊應用	
◇ 品德倫理	
◇ 獨立思考	
◇ 樂活健康	
◇ 團隊合作	
◇ 美學涵養	

授課進度表

週次	日期起訖	內容 (Subject/Topics)	備註
1	101/09/10~ 101/09/16	1. Functions of Derivatives : Price Discovery,Hedge/Insurance, Leverage Trading/ Speculation,Arbitrage/ Spread Trading, Volatility Trading, TaxShield.	
2	101/09/17~ 101/09/23	2. Forwards/Futures Pricing, Index Arbitrage,Hedging, Asset Management using Derivatives.	
3	101/09/24~ 101/09/30	3. Matlab Financial/Derivatives Toolbox on Forwards/Futures.	
4	101/10/01~ 101/10/07	4.Options Combinational Strategies, Matlab, TF2001,Option!, DerivaGem	
5	101/10/08~ 101/10/14	5. Fundamentals of Stochastic/Ito Calculus/ GBSMOptions Pricing Models.	
6	101/10/15~ 101/10/21	6. Greeks and Risk Management	
7	101/10/22~ 101/10/28	7. Monte Carlo Simulation toward OPM, Matlab/Excel.	
8	101/10/29~ 101/11/04	8. Binomial/Trinomial Option Pricing Model (B/TOPM), Matlab.	
9	101/11/05~ 101/11/11	Report I.	
10	101/11/12~ 101/11/18	10. Volatility Smile/Smirk, Matlab	

11	101/11/19~ 101/11/25	11.Implied Volatility Index/ Volatility Models Family,, Matlab.	
12	101/11/26~ 101/12/02	12. Market Sentiment Indexes, Matlab.	
13	101/12/03~ 101/12/09	13. Net Buying Pressure Hypothesis	
14	101/12/10~ 101/12/16	14. Exotic Options, Option!, DerivaGem	
15	101/12/17~ 101/12/23	15. Structured/ Hybrid Securities.	
16	101/12/24~ 101/12/30	16. Asset Securitization.	
17	101/12/31~ 102/01/06	17. Term Structure of Interest Rates Models.	
18	102/01/07~ 102/01/13	18.Report II.	
修課應 注意事項			
教學設備	電腦、投影機		
教材課本	Fabozzi, F.J., Bond Markets, Analysis and Strategies, 5th ed. 2004, Pearson. 此書有中譯本。		
參考書籍	Fabozzi, F.J., Bond Markets, Analysis and Strategies, 5th ed. 2004, Pearson. 此書有中譯本。		
批改作業 篇數	5 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	◆出席率： % ◆平時評量：30.0 % ◆期中評量：30.0 % ◆期末評量：30.0 % ◆其他〈專題報告〉：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。 ※不法影印是違法的行為。請使用正版教科書，勿不法影印他人著作，以免觸法。		