

淡江大學 99 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		
學系(門)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。			
學生基本能力			
<p>A. 培養進階財務金融理論的知識。</p> <p>B. 提升應用理論與實務技巧。</p> <p>C. 加強邏輯推演的能力。</p> <p>D. 財金研究方法的學習與運用。</p> <p>E. 具備表達、組織與應用能力。</p> <p>F. 強化學生溝通與解決問題的能力。</p> <p>G. 提升考取高階財金專業證照之能力。</p> <p>H. 具備學術未來深造的潛力。</p>			
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 advanced 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、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	提升學生對衍生性金融商品理論與實務之應用	Promote students' ability of application in theoretical and practical.	A6	ABCDG

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	提升學生對衍生性金融商品理論與實務之應用	課堂講授、分組討論、參觀實習	期中考、期末考

授課進度表

週次	日期	內容 (Subject/Topics)	備註
1	09/13	固定收益証券與財富管理市場簡介	
2	09/20	債卷與利率換算:Chap.4	
3	09/27	期貨持有成本模型,交割結算及避險:Chap.3,個案一	
4	10/04	利率期貨:Chap.10	
5	10/11	選擇權市場簡介:Chap.9	
6	10/18	股價變動模型及Stochastic Calculus	
7	10/25	ITO處理 Lognormal:Chap.12,個案二	
8	11/01	ITO處理 Lognormal:Chap.12,個案二	
9	11/08	期中考	

10	11/15	無套利機會及The B-S modal:Chap.13,個案三	
11	11/22	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	11/29	Swaps: Chap.7	
13	12/06	利率模型及利率選擇權公式:Chap.26	
14	12/13	Martingales:Chap.25	
15	12/20	凹度及Quanto(跨貨幣)調整:Martingales應用一,Chap.27	
16	12/27	參觀期交所:期貨與選擇權交易模擬教室	
17	01/03	凹度及Quanto(跨貨幣)調整:Martingales應用二,Chap.27	
18	01/10	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： <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>		