

淡江大學 99 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
	TBBMD1A		
學 系(門) 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。			
學 生 基 本 能 力			
A. 奠定紮實的財務金融理論基礎。 B. 整合跨領域理論與實務的應用能力。 C. 熟稔相關財金研究方法與成果。 D. 具備獨立研究的學術能力。 E. 培養金融環境的分析能力。 F. 提升學生的教學素質。 G. 提升學術研究國際化之能力。 H. 強化學術研究團隊合作能力。			
課程簡介	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、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	厚植考取專業財金證照之實力。(專業證照實力)	To be familiar with the methods of deductive/inductive method, integrated processes, and logical thinking. (Scientific/Analytic Competence)	C2	AB

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	厚植考取專業財金證照之實力。(專業證照實力)	課堂講授、分組討論	出席率、報告

授課進度表

週次	日期	內容 (Subject/Topics)	備註
1	09/13	1. Functions of Derivatives : Price Discovery, Hedge/Insurance, Leverage Trading/ Speculation, Arbitrage/ Spread Trading, Volatility Trading, Tax Shield.	
2	09/20	2. Forwards/Futures Pricing, Index Arbitrage, Hedging, Asset Management using Derivatives.	
3	09/27	3. Matlab Financial/Derivatives Toolbox on Forwards/Futures.	
4	10/04	4. Options Combinational Strategies, Matlab, TF2001, Option!, DerivaGem.	
5	10/11	5. Fundamentals of Stochastic/Ito Calculus/ GBSM Options Pricing Models..	
6	10/18	6. Greeks and Risk Management.	

7	10/25	7. Monte Carlo Simulation toward OPM, Matlab/Excel.	
8	11/01	8. Binomial/Trinomial Option Pricing Model (B/T OPM), Matlab.	
9	11/08	9. Report I.	
10	11/15	10. Volatility Smile/Smirk, Matlab.	
11	11/22	11. Implied Volatility Index/ Volatility Models Family,, Matlab.	
12	11/29	12. Market Sentiment Indexes, Matlab.	
13	12/06	13. Net Buying Pressure Hypothesis.	
14	12/13	14. Exotic Options, Option!, DerivaGem.	
15	12/20	15. Structured/ Hybrid Securities.	
16	12/27	16. Asset Securitization.	
17	01/03	17. Term Structure of Interest Rates Models.	
18	01/10	18.Report II.	
修課應注意事項		☒ 期中/期末考試 ☐ 隨堂測驗 ☒ 期末報告 ☐ 實作演練 ☐ 個案分析 ☒ 課堂參與 Grading policy : Homework 30% Reports I(30%) & II(30%).	
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		◆平時考成績：30.0 % ◆期中考成績： % ◆期末考成績：30.0 % ◆作業成績： 30.0 % ◆其他〈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。 ※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。	