

個人資料表

一、基本資料：

中文姓名	徐保鵬
職稱	副教授
研究室	R256
聯絡電話	0987064191
E-mail	penghp@cyut.edu.tw
請益時間	三 5.6；四 5.6
研究專長	財務工程、固定收益證券、理財規劃、保險科技

二、主要學歷

學位	學校名稱	主修學門系所
博士	國立政治大學	金融系
碩士	國立清華大學	經濟系
學士	國立清華大學	數學系

三、現職及與專長相關之經歷（請依任職之時間先後順序由最近者往前追溯）

1. 元培醫事科技大學觀光與休閒管理系專任副教授
2. 元培醫事科大學應用財務管理系專任助理教授
3. 元大寶來綜合經濟研究院兼任研究員

四、著作目錄：

(一) 期刊論文

1. Son-Nan Chen, Pao-Peng Hsu* and Kuo-Yuan Liang. (2019) “Option pricing and hedging in different cyclical structures: A two-dimensional Markov modulated model” *European Journal of Finance*, 25(8), 762-779. (SSCI, A-).
2. Son-Nan Chen and Pao-Peng Hsu*. (2018) “Pricing inflation-indexed derivatives with default risk” *European Journal of Finance*, 24(15), 1272-1287. (SSCI, A-).
3. Son-Nan Chen and Pao-Peng Hsu.* (2018) “Pricing and hedging barrier options under a Markov-modulated double exponential jump diffusion-CIR model,” *International Review of Economics and Finance*, 56, 330-346. (SSCI, B+).
4. Pao-Peng Hsu.* (2017) “Examination of Taiwan's travel and tourism market cycle through a two-period Markov regime-switching model,” *Tourism Management*, 63, 201-208. (SSCI, top 1 in Hospitality, Leisure, Sport & Tourism Categories).
5. Son-Nan Chen, Pao-Peng Hsu* and Chang-Yi Li. (2016) “Pricing credit-risky bonds and spread options with modelling the credit-spread term structures under the two-dimensional Markov-modulated jump-diffusion model,” *Quantitative Finance*, 16(4), 573-592. (SSCI, A-).
6. Son-Nan Chen, Mi-Hsiu Chiang, Pao-Peng Hsu and Chang-Yi Li*. (2014) “Valuation of Quanto options with a regime-switching Gaussian HJM model: Regime-switching risk,” *Finance Research Letters*, 11(2), 161-172. (SSCI, B+).
7. Pao-Peng Hsu and Ying-Hsiu Chen*. (2012) “Barrier option pricing for exchange rates under the Levy-HJM processes,” *Finance Research Letters*, 9, 176-181. (SSCI, B+).
8. Pao-Peng Hsu and Ying-Hsiu Chen*. (2012) “Transforming one-factor mean reversion interest rate model into HJM model under cross-currency economy,” *International Research Journal of Applied Finance*, 3(5), 617-625. (EconLit).
9. Pao-Peng Hsu* and Szu-Lang Liao. (2011) “The portfolio strategy and hedging: a spectrum perspective on Mean-Variance theory,” *International Review of Economics and Finance*, 22, 129-140. (SSCI, B+).
10. Pao-Peng Hsu*, Chen-Hui Yen, Ya-Hui Chang and Li-Ling Chou. (2010). “Cycle and Performance of Mutual Funds— A application of Spectral Analysis,” *Applied Economics Letters*, July, 1-5. (SSCI, B).
11. Szu-Lang Liao and Pao-Peng Hsu*. (2009), “Pricing and Hedging of Quanto Range Accrual Notes



under Gaussian HJM with Cross-Currency Levy Processes,” Journal of Futures Markets, Vol 29, No.10, 973-998. (SSCI, ATier-2).

(二) 專書及專書論文

無

(三) 研討會論文

1. 徐保鵬、葉錦霞、陳群育、陳盈秀，” 觀光對於島嶼生態以及環境的衝擊”，2020 健康管理學術研討會，2020。
2. 徐保鵬、葉錦霞、陳群育、陳盈秀、卓美惠，” 大學生參與路跑動機與滿意度之研究”，2019 健康管理學術研討會暨國際尖端醫學論壇，2019。
3. 徐保鵬、葉錦霞、陳群育、陳盈秀，” 景氣循環樣態與相關違約風險對於觀光休閒產業風險投資決策評估與分析”，2018 生命教育暨健康管理國際學術研討會，2018。
4. 徐保鵬，” Pricing inflation-indexed derivatives with default risk”，105 年統計學術研討會暨政治大學統計學系 50 週年學術研討會，2016.
5. Pao-Peng Hsu and Ying-Hsiu Chen, “The Empirical Analysis and Comparisons Using TAIEX Derivatives,” 17th International Conference on Business, Management, Economics and Finance, in Kuala Lumpur, Malaysia, 2015.
6. Ying-Hsiu Chen and Pao-Peng Hsu, “Impacts of Financial Development and Characteristics on Listed Securities Firms' Efficiency in Taiwan,” International Conference on Economics, Business and Management, Pattaya in Thailand, 2014.
7. Pao-Peng Hsu and Ying-Hsiu Chen, “Pricing Risky Bond under Cox Processes and Multi-Dimensional Levy Processes,” 3rd International Conference on Humanities, Geography and Economics, Bali in Indonesia. 2013.

(四) 技術報告

1. 無

(五) 其他

科技部計畫：

1. 實證以及估計不對稱領先與落後期間:利用歐式買權校準，MOST 103-2410-H-264 -003 -
2. 在 Levy-HJM 模型下建立隱含總體結構之違約債券殖利率曲線以及信用衍生性商品的評價，NSC 102-2410-H-264 -001-
3. 景氣循環對於固定收益證券評價之影響:以 caplet 為例，NSC 101-2410-H-264 -006 -



4. 在景氣循環之下的信用價差殖利率曲線之建立以及信用價差選擇權的評價，
100-2410-H-264-004-
5. 在 two-hazard rate structure 模型下考量信用風險、跳躍風險及匯率風險之連動債評價，
99-2410-H-264-004-
6. 收益率及利率期限結構服從多維度 Variance Gamma 過程的商品期貨評價，
98-2410-H-264-011-

產學合作計畫:

1. 元大投信 ETF 理財機器人，合作廠商: 多維資訊有限公司

註：各類著作請按發表時間先後順序填寫。各項著作請務必依作者姓名（按原出版之次序，通訊作者請加註*。）、出版年、月份、題目、期刊名稱（專書出版社）、起迄頁數之順序填寫，被接受刊登尚未正式出版者請附被接受函。



五、獲獎榮譽及其他之具體績效：

(一)教學優良事蹟 (相關教材發表:獲得本校教材/教學相關獎勵如下)

107 學年度績優導師

108 學年度第二學期教學優質獎勵-課程品質改善(課程:健康休閒活動規劃)

109 學年度第一學期教學優質獎勵-課程品質改善(課程:專題演講)

109 學年度第一學期教學優質獎勵-創新教學模式(課程:專題製作)

109 學年度第一學期教材編纂或教具製作獎勵 (課程:網紅與影音行銷)

(二)近 5 年指導學生參賽得獎列表

2018 全國證期權虛擬投資競賽 第一名 學生 葉又綺

2018 輔仁大學外匯投資競賽 第一名 蘇聖喆、第四名 陳緯儒、第五名揚于亭。

2017 輔仁大學外匯投資競賽 第四名 羅鈺玫、第五名詹明庭

2017 中華大學虛擬投資競賽 第一名 許云華