

淡江大學 100 學年度第 1 學期課程教學計畫表

課程名稱	金融創新	授課 教師	賴冠吉 Lai Kuan-chi
	FINANCIAL INNOVATION		
開課系級	財金四 A	開課 資料	必修 單學期 3學分
	TBBXB4A		
系所教育目標			
配合本校、院教育目標，因應國內外金融情勢的演變，培養財務金融理論與實務兼具的財務金融人才。			
系所核心能力			
<p>A. 具備財務金融理論與實務的基本知識。</p> <p>B. 加強相關金融法規的學習。</p> <p>C. 培養財務金融職場的基本倫理與道德。</p> <p>D. 提升學生的國際觀與外語能力。</p> <p>E. 提升學生專業證照之能力。</p> <p>F. 具備分析國內外金融發展情勢之基本能力。</p>			
課程簡介	<p>本課程之目的是讓同學能透過財務理論基礎的研究及配合實例教學方式，了解如何進行金融創新，同時也透過一些財務工程的方法與電腦系統分析並建立出一套金融創新的流程，實際了解金融創新在資本市場的運作。</p>		
	<p>The purpose of current course is using practical example and teaching method to let students learn to how to research the financial innovation. And by way of Financial Engineering and computer system students can analysis and make the procedures of financial innovation, realize the practice of capital market.</p>		

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	1.金融商品的演進過程	1.The evolution of Financial Products	C2	AF
2	2.金融創新的概念	2.The concept of Financial Innovation	C2	AF
3	3.基礎線性金融商品	3.The Foundation of Linear Financial Products	C4	ABF
4	4.基礎非線性金融商品	4.The Foundation of non Linear Financial Products	C4	ABCF
5	5.基礎財務數學模型	5.The Foundation of Financial Mathematics	C4	ABF
6	6.金融創新商品實例設計分析	6.The Analysis of Financial Innovation Products	C3	ABDF
7	7.金融創新的過程與設計	7.The Process of Financial Innovation	C6	ABF
8	8.其他金融創新的方法	8.The alternative method of Financial Innovation	C6	ACF

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	1.金融商品的演進過程	課堂講授	出席率、期中考
2	2.金融創新的概念	課堂講授	出席率、期中考
3	3.基礎線性金融商品	課堂講授	出席率、期中考
4	4.基礎非線性金融商品	課堂講授	出席率、期中考
5	5.基礎財務數學模型	課堂講授	出席率、期末考
6	6.金融創新商品實例設計分析	課堂講授	出席率、期末考

7	7.金融創新的過程與設計	課堂講授	出席率、期末考
8	8.其他金融創新的方法	課堂講授	出席率、期末考
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	課程簡介 / 金融創新簡介	
2	100/09/12~ 100/09/18	金融商品發展與市場結構(商品介紹與結構)	
3	100/09/19~ 100/09/25	股票 (為何有股票、市場意義、股票市場基本運作)	
4	100/09/26~ 100/10/02	股票(創新評價模型、創新篩選模型)	
5	100/10/03~ 100/10/09	期貨、遠期契約(模型、市場意義、結構)	
6	100/10/10~ 100/10/16	選擇權(模型、市場意義、結構)	
7	100/10/17~ 100/10/23	債券(模型、市場意義、結構)	
8	100/10/24~ 100/10/30	利率、交換(模型、市場意義、結構)	
9	100/10/31~ 100/11/06	期中考試週	
10	100/11/07~ 100/11/13	基礎財務數學(基礎數學、財務模型)	
11	100/11/14~ 100/11/20	認購權證之金融創新	

12	100/11/21~ 100/11/27	特別股、普通股之金融創新	
13	100/11/28~ 100/12/04	債券之金融創新	
14	100/12/05~ 100/12/11	可轉換公司債金融創新	
15	100/12/12~ 100/12/18	利率交換、利率選擇權金融創新	
16	100/12/19~ 100/12/25	結構型商品的金融創新	
17	100/12/26~ 101/01/01	策略交易的金融創新	
18	101/01/02~ 101/01/08	期末考試週	
修課應 注意事項			
教學設備	電腦、投影機		
教材課本	講義		
參考書籍	Options, Futures, and Other Derivatives, 7th Edition NEW May 2008		
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：10.0 % ◆期中考成績：40.0 % ◆期末考成績：50.0 % ◆作業成績： % ◆其他〈 〉： %		
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。		