

淡江大學 100 學年度第 2 學期課程教學計畫表

課程名稱	財務工程	授課 教師	林蒼祥 LIN WILLIAM T.
	FINANCIAL ENGINEERING		
開課系級	財金一碩士班 A	開課 資料	必修 單學期 3學分
	TBBMM1A		
系（所）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。			
系（所）核心能力			
<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. 提升考取高階財金專業證照之能力。</p> <p>F. 具備學術未來深造的潛力。</p>			
課程簡介	本課程介紹財務工程的基本觀念及新穎的金融商品，包括奇異選擇權、結構型商品、CDS及CDO等。同期望藉由各類金融創新商品的實際發行案例，協助學生更快速掌握商品的特色及應用。		
	This course describes the basic concepts of financial engineering, and innovative financial products, including exotic options, structured products, CDS, and CDO and so on. With the hope that through all kinds of financial innovation, the actual distribution of goods cases, to help students more quickly master the product's features and applications.		

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. 學生將能夠歸納課程中介紹到的概念，包含下列主題：歷史觀點、發展中的媒體實務、個人意義、倫理與政策議題、學習機會與社群。	1. Students will be able to summarize concepts covered in the following topics: Historical Perspective, New Media Practices, Personal Meanings, Ethical and Policy Issues, Learning Opportunities, and Community.	C2	ABCD
2	2. 學生將能夠對於較深入的議題，細述理由。議題例如：可信度、近用、隱私、審查、全球化。	2. Students will be able to interpret in-depth issues such as: credibility, access, privacy, and globalization.	C4	ABC
3	3. 學生將能夠發現新型態媒體，對於教學(者)、學習(者)、新型態素養之發展等的思考方向與意涵。	Students will be able to discover what new media mean for teaching, learning, and literacy development.	C4	ABC

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. 學生將能夠歸納課程中介紹到的概念，包含下列主題：歷史觀點、發展中的媒體實務、個人意義、倫理與政策議題、學習機會與社群。	講述、討論、實作、參訪	紙筆測驗、報告、上課表現
2	2. 學生將能夠對於較深入的議題，細述理由。議題例如：可信度、近用、隱私、審查、全球化。	講述、討論、實作、參訪	紙筆測驗、報告、上課表現
3	3. 學生將能夠發現新型態媒體，對於教學(者)、學習(者)、新型態素養之發展等的思考方向與意涵。	講述、討論、實作、參訪	紙筆測驗、報告、上課表現

本課程之設計與教學已融入本校校級基本素養與核心能力

淡江大學校級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	101/02/13~ 101/02/19	課程簡介	
2	101/02/20~ 101/02/26	Stochastic Calculus:Wiener Process	
3	101/02/27~ 101/03/04	It 's lemma及Case Study(I): Option交易平台	
4	101/03/05~ 101/03/11	Black-Scholes model及European Call and Put	
5	101/03/12~ 101/03/18	Case Study(II)股價指數連動債	
6	101/03/19~ 101/03/25	結構型債券 (I)	
7	101/03/26~ 101/04/01	結構型債券 (II)及Case Study (IV)	
8	101/04/02~ 101/04/08	Swaps (I)	
9	101/04/09~ 101/04/15	Swaps (II)及Case Study (III)	
10	101/04/16~ 101/04/22	期中考試週	
11	101/04/23~ 101/04/29	參觀期交所	
12	101/04/30~ 101/05/06	Option 交易策略及避險策略(II)	

13	101/05/07~ 101/05/13	Value at Risk (I)	
14	101/05/14~ 101/05/20	Value at Risk (II)	
15	101/05/21~ 101/05/27	參加2012 Conference on East Asia Finance	
16	101/05/28~ 101/06/03	Real Option	
17	101/06/04~ 101/06/10	波動性計量模型	
18	101/06/11~ 101/06/17	期末考試週	
修課應 注意事項			
教學設備		(無)	
教材課本		John C.Hull (Seventh Edition)"Options,Futures and Other Derivatives	
參考書籍		1.工商時報 2.經濟日報3.金融商品實例4. 寶來證券等金融網站	
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		◆出席率： 20.0 % ◆平時評量：40.0 % ◆期中評量：40.0 % ◆期末評量： % ◆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。 ※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。	