

淡江大學 101 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
	TLBXM1A		
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	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	A

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	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

淡江大學校級基本素養	內涵說明
◇ 全球視野	
◇ 洞悉未來	
◇ 資訊運用	
◇ 品德倫理	
◇ 獨立思考	
◇ 樂活健康	
◇ 團隊合作	
◇ 美學涵養	

授課進度表

週次	日期起訖	內容 (Subject/Topics)	備註
1	102/02/18~ 102/02/24	課程簡介	
2	102/02/25~ 102/03/03	Stochastic Calculus:Wiener Process	
3	102/03/04~ 102/03/10	It 's lemma及Case Study(I): Option交易平台	
4	102/03/11~ 102/03/17	Black-Scholes model及European Call and Put	
5	102/03/18~ 102/03/24	Case Study(II)股價指數連動債	
6	102/03/25~ 102/03/31	結構型債券 (I)	
7	102/04/01~ 102/04/07	結構型債券 (II)及Case Study (IV)	
8	102/04/08~ 102/04/14	Swaps (I)	
9	102/04/15~ 102/04/21	Swaps (II)及Case Study (III)	
10	102/04/22~ 102/04/28	期中考試週	
11	102/04/29~ 102/05/05	參觀期交所	
12	102/05/06~ 102/05/12	Option 交易策略及避險策略(II)	

13	102/05/13~ 102/05/19	Value at Risk (I)	
14	102/05/20~ 102/05/26	Value at Risk (II)	
15	102/05/27~ 102/06/02	參加2012 Conference on East Asia Finance	
16	102/06/03~ 102/06/09	Real Option	
17	102/06/10~ 102/06/16	波動性計量模型	
18	102/06/17~ 102/06/23	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： <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>※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。</b>	