

淡江大學 103 學年度第 2 學期課程教學計畫表

課程名稱	高等財務工程	授課 教師	鄭婉秀 WAN-HSIU CHENG
	ADVANCED FINANCIAL ENGINEERING		
開課系級	財金一博士班 A	開課 資料	選修 單學期 3學分
	TLBXD1A		
系（ 所 ） 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。			
系（ 所 ） 核 心 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. 提升學生的教學能力。 F. 提升學術研究國際化之能力。			
課程簡介	本課程進階研究衍生性商品之定價與應用。		
	This course is an advanced introduction to derivatives, involving pricing models and further 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	衍生性商品進階介紹	Advanced introduction to derivatives.	C2	AC
2	定價模型。	Pricing models.	C4	BCD
3	衍生性商品的應用。	Application in derivative securities.	C4	DF

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	衍生性商品進階介紹	講述、討論	報告
2	定價模型。	講述、討論	報告
3	衍生性商品的應用。	講述、討論	報告

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	培養認識國際社會變遷的能力，以更寬廣的視野了解全球化的發展。
◇ 資訊運用	熟悉資訊科技的發展與使用，並能收集、分析和妥適運用資訊。
◇ 洞悉未來	瞭解自我發展、社會脈動和科技發展，以期具備建構未來願景的能力。
◇ 品德倫理	了解為人處事之道，實踐同理心和關懷萬物，反省道德原則的建構並解決道德爭議的難題。
◇ 獨立思考	鼓勵主動觀察和發掘問題，並培養邏輯推理與批判的思考能力。
◇ 樂活健康	注重身心靈和環境的和諧，建立正向健康的生活型態。
◇ 團隊合作	體察人我差異和增進溝通方法，培養資源整合與互相合作共同學習解決問題的能力。
◇ 美學涵養	培養對美的事物之易感性，提升美學鑑賞、表達及創作能力。

授 課 進 度 表

週次	日期起訖	內 容 (Subject/Topics)	備 註
1	104/02/24~ 104/03/01	Introduction	
2	104/03/02~ 104/03/08	Pricing and Hedging Strategies I	
3	104/03/09~ 104/03/15	Pricing and Hedging Strategies II	
4	104/03/16~ 104/03/22	Securitization and the Credit Crisis of 2007	
5	104/03/23~ 104/03/29	Option Markets	
6	104/03/30~ 104/04/05	Trading Strategies Involving Options	
7	104/04/06~ 104/04/12	Option Pricing I	
8	104/04/13~ 104/04/19	Option Pricing II	
9	104/04/20~ 104/04/26	Option Pricing III	
10	104/04/27~ 104/05/03	Midterm	
11	104/05/04~ 104/05/10	Greek Letters	
12	104/05/11~ 104/05/17	Volatility Smiles	

13	104/05/18~ 104/05/24	Value at Risk	
14	104/05/25~ 104/05/31	Exotic Options	
15	104/06/01~ 104/06/07	Energy and Commodity Derivatives	
16	104/06/08~ 104/06/14	Credit Derivatives	
17	104/06/15~ 104/06/21	Real Options	
18	104/06/22~ 104/06/28	Final	
修課應 注意事項			
教學設備		電腦、投影機	
教材課本		Options, Futures, and Other Derivatives, 8e, Hull, 2012. (雙葉) Principles of Financial Engineering, 2e, Neftci, 2008. (新陸)	
參考書籍		Reference Papers.	
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： % ◆平時評量： % ◆期中評量：50.0 % ◆期末評量：50.0 % ◆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/CS/main.php 〉業務連結「教師教學 計畫表上傳下載」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。	