

淡江大學 104 學年度第 1 學期課程教學計畫表

課程名稱	財務工程概論	授課 教師	夏斌威 SHIA, PIN-WEI
	FUNDAMENTALS OF FINANCIAL ENGINEERING		
開課系級	財金進學班三A	開課 資料	選修 單學期 2學分
	TLBXE3A		
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>本門課程旨在讓學生學習財務工程的重要觀念及工具。課程內容包括：常用的財務工程模型、選擇權觀念及應用、波動率、權證、指數股票型基金、及結構型商品等。此外，課程也將探討理論模型的交易實務應用。透過此門課，期許同學能學會重要的財務工程模型，並更進一步了解如何運用於金融實務。</p>		
	<p>This course is designed to introduce the basic concepts and tools of financial engineering. The course takes a broad view of the subject and invests time in some useful pricing models, index options, volatility, warrants, Exchange Traded Funds and structured products. Furthermore, case study of financial derivatives will be discussed as topics are covered. On completing the course students are expected to acquire an understanding of the formal techniques and to gain insight into the manipulation of models.</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	介紹財務工程的基本觀念及工具	Introduce the basic concepts and financial engineering tools	C1	A
2	學生將能在瞭解財務研究議題的情況下，實際搜集資料並利用電腦統計軟體進行分析、解讀與應用	Students will be able to discover popular financial issues, collect relative data, use the computer program to get analyzing results. They are also required to interpret or explain the empirical evidence	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	介紹財務工程的基本觀念及工具	講述	紙筆測驗
2	學生將能在瞭解財務研究議題的情況下，實際搜集資料並利用電腦統計軟體進行分析、解讀與應用	講述	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	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	104/09/14~ 104/09/20	財務工程導論	
2	104/09/21~ 104/09/27	金融市場動態	
3	104/09/28~ 104/10/04	常用財務工程工具	
4	104/10/05~ 104/10/11	風險與報酬	
5	104/10/12~ 104/10/18	期貨基本概念	
6	104/10/19~ 104/10/25	期貨交易策略	
7	104/10/26~ 104/11/01	選擇權基本概念	
8	104/11/02~ 104/11/08	選擇權交易策略	
9	104/11/09~ 104/11/15	波動率基本概念	
10	104/11/16~ 104/11/22	期中考試週	
11	104/11/23~ 104/11/29	波動率交易實務	
12	104/11/30~ 104/12/06	權證基本概念	

13	104/12/07~ 104/12/13	權證交易實務	
14	104/12/14~ 104/12/20	指數股票基金(ETF)基本概念	
15	104/12/21~ 104/12/27	指數股票基金(ETF)交易實務	
16	104/12/28~ 105/01/03	結構型商品簡介	
17	105/01/04~ 105/01/10	結構型商品實務探討	
18	105/01/11~ 105/01/17	期末考試週	
修課應 注意事項	學生應遵守學校基本上課規定		
教學設備	電腦、投影機		
教材課本	蔡蒔銓、陳凌鶴、曾盟雅，2010年，財務工程實務與個案探討，證基會		
參考書籍	林蒼祥、蔡蒔銓、孫效孔、邱文昌合著，2010年，期貨與選擇權：財務工程基礎理論與實務，前程文化出版 John C. Hull著，胡次熙譯，期貨與選擇權市場(七版)，華泰文化		
批改作業 篇數	2 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： 10.0 %   ◆平時評量：20.0 %   ◆期中評量：30.0 % ◆期末評量：40.0 % ◆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/CS/main.php">http://www.acad.tku.edu.tw/CS/main.php</a> 〉業務連結「教師教學 計畫表上傳下載」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>		