

淡江大學 105 學年度第 2 學期課程教學計畫表

課程名稱	財務工程研討	授課 教師	蕭堯仁 YAO-JEN HSIAO
	FINANCIAL ENGINEERING SEMINAR		
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>本課程探討國際情勢與本土化的內容，在闡述財務工程理論之外，亦配合時事發展來完整討論各類新金融商品的發展。課程也會探討國際著名的金融創新實例，以及過去幾年大型投資銀行與金融機構曾在台灣市場發行的商品作為探討案例，讓學生能透過這些案例來瞭解投資銀行如何利用財務工程與金融創新來迎合不同國家、不同投資者的需求，設計出最符合市場狀況的金融商品。</p>		
	<p>This course provides new types of financial products in addition to the theory of financial engineering, and also explores examples of international financial innovations that will help students understand how financial engineering and financial innovation can be used to meet the needs of different countries and investors and to design financial products that are most in line with market conditions.</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	1.讓學生瞭解財務工程應用的種類與重要性。 2.利用案例探討財務工程方法的分析與應用。	1.Understand the types of financial engineering applications and the importance of. 2.Analysis and Application of Financial Engineering Methods by Case Study.	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	1.讓學生瞭解財務工程應用的種類與重要性。 2.利用案例探討財務工程方法的分析與應用。	講述、討論	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	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	106/02/13~ 106/02/19	金融創新之概念/The Concept of Financial Innovation	
2	106/02/20~ 106/02/26	遠期契約與期貨/Forward contracts and futures	
3	106/02/27~ 106/03/05	交換/exchange	
4	106/03/06~ 106/03/12	選擇權/Option	
5	106/03/13~ 106/03/19	債券之金融創新/Financial Innovation of Bonds	
6	106/03/20~ 106/03/26	普通股之金融創新/Financial innovation of common stock	
7	106/03/27~ 106/04/02	個案討論-歐式股票選擇權的評價/Case study-Blackand Scholes Model	
8	106/04/03~ 106/04/09	個案討論-蒙地卡羅模擬與二項式模型/Case study-Monte Carlo Simulation and Binomial Model	
9	106/04/10~ 106/04/16	報告繳交與討論	
10	106/04/17~ 106/04/23	期中考試週	
11	106/04/24~ 106/04/30	認購權證與可轉換證券之金融創新/Financial Innovation of Call Warrants and Convertible Securities	

12	106/05/01~ 106/05/07	結構型債券之金融創新/Financial Innovation of Structured Bond	
13	106/05/08~ 106/05/14	證券化金融商品/Securitized Financial Commodities (I)	
14	106/05/15~ 106/05/21	證券化金融商品/Securitized Financial Commodities (II)	
15	106/05/22~ 106/05/28	信用衍生性金融商品/Credit derivative financial products	
16	106/05/29~ 106/06/04	個案討論-隨機利率下零息債券的評價/Case study	
17	106/06/05~ 106/06/11	報告繳交與討論	
18	106/06/12~ 106/06/18	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		呂瑞秋(2015), 財務工程：財務評價與風險管理的科學及技巧, 新陸書局。 謝劍平(2010), 金融創新：財務工程的實務奧祕, 智勝書局。	
參考書籍		陳達新、周恆志(2014), 財務風險管理：工具、衡量與未來發展(三版), 雙葉出版。 廖四郎;陳惟龍;程國榮;高子鈞;董夢雲(2013), 財務工程理論與實務, 財團法人中華民國證券暨期貨市場發展基金會。	
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：10.0 %    ◆期中評量：25.0 % ◆期末評量：25.0 % ◆其他〈書面報告〉：20.0 %	
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>	