

淡江大學 106 學年度第 1 學期課程教學計畫表

課程名稱	高等財務數理	授課 教師	王仁和 WANG, REN-HE
	ADVANCE MATHEMATIC FINANCE		
開課系級	財金一博士班 A	開課 資料	必修 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	本課程介紹一些進階的財務數量方法及財務模型，讓學生可以加以應用到財務的研究方法及分析能力。		
	This is a course about advanced financial economics and financial modelling. Let the students can apply the methods to research and analysis.		

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	讓學生學習進階的財務數量方法及模型，增進研究潛力。	Let the students to learn advanced financial quantitative methods and financial models, to promote research potential.	P6	ACD

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	讓學生學習進階的財務數量方法及模型，增進研究潛力。	講述、討論	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	106/09/18~ 106/09/24	Elements of Matrix Algebra	
2	106/09/25~ 106/10/01	Linear and Matrix Algebra	
3	106/10/02~ 106/10/08	Statistical Concepts	
4	106/10/09~ 106/10/15	Brownian Motion	
5	106/10/16~ 106/10/22	Stochastic Calculus	
6	106/10/23~ 106/10/29	Stochastic Calculus	
7	106/10/30~ 106/11/05	Risk-Neutral Pricing	
8	106/11/06~ 106/11/12	Risk-Neutral Pricing	
9	106/11/13~ 106/11/19	Asset Returns, Interest Rates and Market Data	
10	106/11/20~ 106/11/26	Estimation and Modeling of Volatilities	
11	106/11/27~ 106/12/03	Estimation and Modeling of Volatilities	
12	106/12/04~ 106/12/10	Interest Rate Market and Term Structure Models	

13	106/12/11~ 106/12/17	Interest Rate Market and Term Structure Models	
14	106/12/18~ 106/12/24	Analysis of Financial Time Series	
15	106/12/25~ 106/12/31	Analysis of Financial Time Series	
16	107/01/01~ 107/01/07	Analysis of Financial Time Series	
17	107/01/08~ 107/01/14	Analysis of Financial Time Series	
18	107/01/15~ 107/01/21	Final Exam.	
修課應 注意事項			
教學設備		電腦、投影機	
教材課本		管仲閔 計量經濟學講義 Analysis of Financial Time Series. Author :Ruey S. Tsay Asset Pricing. John H. Cochrane. Princeton University Press.	
參考書籍			
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。	