

淡江大學 109 學年度第 1 學期課程教學計畫表

課程名稱	財務管理研討	授課 教師	林志娟 LIN JYH-JIUAN
	SEMINAR IN FINANCIAL MANAGEMENT		
開課系級	大數據碩一 A	開課 資料	以實整虛課程 必修 單學期 3學分
	TLXDM1A		
系 ( 所 ) 教育目標			
<p>一、培育學生具研究大數據的能力。</p> <p>二、培育學生具大數據程式設計的能力。</p>			
本課程對應院、系(所)核心能力之項目與比重			
<p>A. 具研究大數據分析理論的能力。(比重：40.00)</p> <p>C. 具整合各領域之知識的能力。(比重：40.00)</p> <p>D. 具邏輯推理的能力。(比重：20.00)</p>			
本課程對應校級基本素養之項目與比重			
<p>1. 全球視野。(比重：30.00)</p> <p>3. 洞悉未來。(比重：30.00)</p> <p>5. 獨立思考。(比重：20.00)</p> <p>7. 團隊合作。(比重：20.00)</p>			
課程簡介	<p>本課程的架構含透過統計研究分析方法與財務理論結合，應用財務數據，以電腦語言PYTHON萃取出其中的財務相關資訊與意涵，供決策參考。</p>		
	<p>本課程不僅採用實體教室、翻轉教室、線上學習混合式教學方式，更導入了PBL的學習方式，採分組共同討論，根據投資人屬性設計財務商品。完成前一週，各組別所設計的財務商品並導入程式。</p>		
	<p>This course focuses on the blending of the financial theory and programming language to the financial application. It introduces the statistical and financial theory in empirical applications along with PYTHON. Not only blends on-line and flip classroom teaching style but also adopts project-based learning methods, this course cultivates students the integrated ability of designing and solving a financial problem as well as implementing the python language. Deploy the model into production is the learning goal.</p>		

本課程教學目標與認知、情意、技能目標之對應

將課程教學目標分別對應「認知 (Cognitive)」、「情意 (Affective)」與「技能(Psychomotor)」的各目標類型。

- 一、認知(Cognitive)：著重在該科目的事實、概念、程序、後設認知等各類知識之學習。
- 二、情意(Affective)：著重在該科目的興趣、倫理、態度、信念、價值觀等之學習。
- 三、技能(Psychomotor)：著重在該科目的肢體動作或技術操作之學習。

序號	教學目標(中文)	教學目標(英文)
1	透過統計研究分析方法與財務理論結合，應用財務大數據，以電腦語言萃取出其中的財務相關資訊與意涵，供決策參考。	Cultivate students with ability for statistical analysis and programming.
2	透過統計研究分析方法與財務理論結合，應用財務數據，以電腦語言PYTHON萃取出其中的財務相關資訊與意涵，供決策參考。	This course focuses on the blending of the financial theory and programming language to the financial application. It introduces the statistical and financial theory in empirical applications along with PYTHON.

教學目標之目標類型、核心能力、基本素養教學方法與評量方式

序號	目標類型	院、系(所)核心能力	校級基本素養	教學方法	評量方式
1	認知	ACD	1357	講述、討論、發表、實作	作業、討論(含課堂、線上)、報告(含口頭、書面)
2	認知	ACD	1357	講述、討論、實作	測驗、作業、討論(含課堂、線上)、實作、報告(含口頭、書面)、活動參與

授課進度表

週次	日期起訖	內容 (Subject/Topics)	備註 (採數位教學之週次，請填「線上非同步教學」)
1	109/09/14~109/09/20	第1週 財務領域與課程介紹	(實體上課)
2	109/09/21~109/09/27	第2週 財務報酬率介紹	(實體上課)
3	109/09/28~109/10/04	第3週 PYTHON環境設定介紹與基礎語法	線上非同步教學1
4	109/10/05~109/10/11	第4週 第一次實際演練	(實體上課)
5	109/10/12~109/10/18	第5週 PYTHON與報酬計算	線上非同步教學2
6	109/10/19~109/10/25	第6週 風險類型與量化	(實體上課)
7	109/10/26~109/11/01	第7週 風險實務應用與PYTHON計算	線上非同步教學3
8	109/11/02~109/11/08	第8週 第二次實際演練	(實體上課)
9	109/11/09~109/11/15	第9週 投資組合風險定義與實務應用(線上課程)	線上非同步教學4

10	109/11/16~ 109/11/22	midterm week	
11	109/11/23~ 109/11/29	第11週 業師請益演講/第一金投信(視演講者時間調整)	(實體上課)
12	109/11/30~ 109/12/06	第12週 MARKOWITZ 投資組合理論與效率前緣	(實體上課)
13	109/12/07~ 109/12/13	第13週 PYTHON與效率前緣	(實體上課)
14	109/12/14~ 109/12/20	第14週 校外教學校外教學/參觀臺灣集保結算所所設立的臺灣股票博物館(日期視狀況調整)	校外教學
15	109/12/21~ 109/12/27	第15週 MONTE CARLO模擬法與資產優化	(實體上課)
16	109/12/28~ 110/01/03	第16週 業師請益/日盛國際租賃(股)公司(實體上課) (日期視狀況調整)	(實體上課)
17	110/01/04~ 110/01/10	第17週 分組PBL專題報告(實體上課)	(實體上課)
18	110/01/11~ 110/01/17	Final week	
修課應 注意事項	本課程視經費申請結果將安排1-2場校外專家進行演講		
教學設備	電腦、投影機		
教科書與 教材	LECTURE NOTES		
參考文獻	Philippe Jorion (2009). Financial Risk Manager Handbook,5th edition, GARP, John Wiley & Sons, Inc. Portfolio Optimization with R/Rmetrics,2009,Diethelm W&#252;rtz,ohan Chalabi,William Chen&#226;Andrew Ellis Financial risk modelling and portfolio optimization with R / Bernhard Pfaff. 金融科技實戰：Python與量化投資/ 蔡立崙著		
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： 10.0 %   ◆平時評量：30.0 %   ◆期中評量：30.0 % ◆期末評量：30.0 % ◆其他〈 〉：        %		

備 考	<ol style="list-style-type: none"><li>1. 「教學計畫表管理系統」網址：<a href="https://info.ais.tku.edu.tw/csp">https://info.ais.tku.edu.tw/csp</a> 或由教務處首頁→教務資訊「教學計畫表管理系統」進入。</li><li>2. 依「專科以上學校遠距教學實施辦法」第2條規定：「本辦法所稱遠距教學課程，指每一科目授課時數二分之一以上以遠距教學方式進行」。</li><li>3. 依「淡江大學數位教學施行規則」第3條第2項，本校遠距教學課程須為「於本校遠距教學平台或同步視訊系統進行數位教學之課程。授課時數包含課程講授、師生互動討論、測驗及其他學習活動之時數」。</li><li>4. 如有課程臨時異動(含遠距教學、以實整虛課程之上課時間及教室異動)，請依規定向教務處提出申請。</li></ol> <p><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></p>
-----	---