

淡江大學 1 1 1 學年度第 1 學期課程教學計畫表

課程名稱	財務工程研討專題	授課 教師	林允永 LIN YUN-YUNG
	SPECIAL TOPICS ON FINANCIAL ENGINEERING		
開課系級	財金一碩專班 A	開課 資料	實體課程 選修 單學期 3學分
	TLBXJ1A		
課程與SDGs 關聯性	SDG1 消除貧窮 SDG4 優質教育 SDG8 尊嚴就業與經濟發展		
系 (所) 教育 目 標			
提供財務金融產業人才之專業訓練課程，以落實實務與理論融合應用之能力。			
本課程對應院、系(所)核心能力之項目與比重			
A. 具備理論與實務融合應用之能力。(比重：30.00) B. 具備個案研究與分析的能力。(比重：20.00) C. 培養具備企業財務決策與分析之能力。(比重：10.00) D. 發展專業競爭的能力與態度。(比重：10.00) E. 提升財金研究理論與方法之素養。(比重：20.00) F. 提升考取高階財金專業證照之能力。(比重：10.00)			
本課程對應校級基本素養之項目與比重			
1. 全球視野。(比重：5.00) 2. 資訊運用。(比重：20.00) 3. 洞悉未來。(比重：5.00) 4. 品德倫理。(比重：5.00) 5. 獨立思考。(比重：30.00) 6. 樂活健康。(比重：5.00) 7. 團隊合作。(比重：20.00) 8. 美學涵養。(比重：10.00)			
課程簡介	本課程教學內容旨在滿足碩專班學生之財務工程理論學以致用需求，實務分析將先從證券與期貨市場之標準化衍生性商品著手，再至連動債與人民幣TRF(可贖回遠期契約)等非標準化金融商品。教學內容著重舉實例或個案解說財工理論之形成背景與意義，使學生了解衍生性商品之訂價與避險原理，並儘量佐以個案研究，解說財工理論在交易、避險、套利 課程簡介 與新金融商品之應用		

We aim to meet what EMBA finance students want, i.e., fundamental to financial engineering theory and applications. We show how to establish the fair prices of derivatives with figure drawing and high school math rather than with advanced calculus. To show the practical uses of financial engineering in pricing, hedging and arbitrage, case studies and calculation problems are also provided.

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	滿足碩專班學生之學以致用需求。	to link the theoretical ideas to practical issues.
2	交易、避險等各項專題之應用。	to show the practical uses of financial engineering in pricing and arbitrage etc.

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	ABCDEF	12345678	講述、討論	作業、討論(含課堂、線上)、報告(含口頭、書面)
2	認知	ABCDEF	12345678	講述、討論	討論(含課堂、線上)、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
1	111/09/05~111/09/11	課程簡介	
2	111/09/12~111/09/18	期貨與選擇權交易策略討論	
3	111/09/19~111/09/25	期貨與選擇權交易策略討論	
4	111/09/26~111/10/02	標的資產的價格隨機變動模型	
5	111/10/03~111/10/09	衍生商品的價格變動模型、lognormal property、及實務應用	
6	111/10/10~111/10/16	Black-Scholes model及歐式選擇權價格公式之解析	
7	111/10/17~111/10/23	實務個案討論	

8	111/10/24~ 111/10/30	實務個案討論	
9	111/10/31~ 111/11/06	實務個案討論	
10	111/11/07~ 111/11/13	期中考試週	
11	111/11/14~ 111/11/20	期貨的訂價	
12	111/11/21~ 111/11/27	期貨的基差、避險及套利	
13	111/11/28~ 111/12/04	參訪期貨或證券公司	
14	111/12/05~ 111/12/11	實務個案討論	
15	111/12/12~ 111/12/18	實務個案討論	
16	111/12/19~ 111/12/25	期末報告討論	
17	111/12/26~ 112/01/01	期末報告討論	
18	112/01/02~ 112/01/08	期末考試週	
修課應 注意事項	1. 本課程以實務案例為主來討論財務工程的應用 2. 理論部分會精簡數學部分著重在直覺的理解, 會以報刊雜誌上的報導專題來討論財務工程的問題		
教學設備	電腦		
教科書與 教材	黃泓人編譯(J Hull著), 期貨與選擇權市場, 華泰出版社		
參考文獻			
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：40.0 % ◆期末評量：40.0 % ◆其他〈課堂討論〉：20.0 %		
備考	「教學計畫表管理系統」網址： https://info.ais.tku.edu.tw/csp 或由教務處 首頁→教務資訊「教學計畫表管理系統」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。		