

淡江大學 113 學年度第 1 學期課程教學計畫表

課程名稱	衍生性金融商品	授課 教師	(多位教師合開) 林允永 LIN YUN-YUNG
	INTRODUCTION TO DERIVATIVES		
開課系級	財金一博士班 A	開課 資料	實體課程 選修 單學期 3學分
	TLBXD1A		
課程與SDGs 關聯性	SDG1 消除貧窮 SDG4 優質教育		
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。			
本課程對應院、系(所)核心能力之項目與比重			
<p>A. 奠定紮實的財務金融理論基礎。(比重：30.00)</p> <p>B. 整合跨領域理論與實務的應用能力。(比重：10.00)</p> <p>C. 熟稔相關財金研究方法與成果。(比重：30.00)</p> <p>D. 具備獨立研究的學術能力。(比重：10.00)</p> <p>E. 提升學生的教學能力。(比重：10.00)</p> <p>F. 提升學術研究國際化之能力。(比重：10.00)</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：5.00)</p> <p>2. 資訊運用。(比重：20.00)</p> <p>3. 洞悉未來。(比重：10.00)</p> <p>4. 品德倫理。(比重：10.00)</p> <p>5. 獨立思考。(比重：30.00)</p> <p>6. 樂活健康。(比重：10.00)</p> <p>7. 團隊合作。(比重：10.00)</p> <p>8. 美學涵養。(比重：5.00)</p>			
課程簡介	本課程為財金博士班進階專業課程，討論衍生性金融商品的最近發展文獻，尤其注重在討論衍生性金融商品計價模型及隨機微積分在計價過程的應用		

	This course is advanced professional financial Ph.D seminar. We will discuss the recently development in derivative market and the pricing model of derivative product. We also focus the application of stochastic calculus in the pricing model.
--	--

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	透過討論讓同學了解衍生性金融商品的訂價模型及隨機微積分在衍生性金融商品的應用	The main object of this course is to introduce the application of stochastic calculus in pricing model of derivative product.
2	培養同學應用隨機微積分在衍生性金融商品定價模式的應用	the application of stochastic calculus in pricing model of derivative products.

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	1234567	講述、討論、發表、實作	測驗、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、發表	測驗、作業、討論(含課堂、線上)、報告(含口頭、書面)

授課進度表

週次	日期起訖	內容 (Subject/Topics)	備註
1	113/09/09~ 113/09/15	paper discussing	
2	113/09/16~ 113/09/22	paper discussing	
3	113/09/23~ 113/09/29	paper discussing	
4	113/09/30~ 113/10/06	paper discussing and home work	
5	113/10/07~ 113/10/13	paper discussing	
6	113/10/14~ 113/10/20	校外參訪--期貨交易所	
7	113/10/21~ 113/10/27	paper discussing	
8	113/10/28~ 113/11/03	paper discussing and home work	

9	113/11/04~ 113/11/10	midterm exam and term paper topic discussing	
10	113/11/11~ 113/11/17	paper discussing	
11	113/11/18~ 113/11/24	paper discussing	
12	113/11/25~ 113/12/01	paper discussing	
13	113/12/02~ 113/12/08	校外參訪--國票期貨	
14	113/12/09~ 113/12/15	paper discussing	
15	113/12/16~ 113/12/22	paper discussing	
16	113/12/23~ 113/12/29	paper discussing	
17	113/12/30~ 114/01/05	paper discussing and home work	
18	114/01/06~ 114/01/12	final exam and term paper present	
課程培養 關鍵能力	自主學習、資訊科技、問題解決、跨領域		
跨領域課程			
特色教學 課程			
課程 教授內容	邏輯思考		
修課應 注意事項	每位同學期末須繳交一篇期末研究報告，期末報告形式同投稿期刊，第9週會討論 期末報告大綱，第18週課堂20分鐘發表，這是進階專業課程，不建議博一同學修課		
教科書與 教材	採用他人教材：簡報、講義、期刊論文		
參考文獻			
學期成績 計算方式	◆出席率： 10.0 %   ◆平時評量：20.0 %   ◆期中評量：20.0 % ◆期末評量：        % ◆其他〈term paper〉：50.0 %		

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。**