

淡江大學 99 學年度第 1 學期課程教學計畫表

課程名稱	金融創新	授課 教師	林容竹 Lin, Jung-chu
	FINANCIAL INNOVATION		
開課系級	財金四 B	開課 資料	必修 單學期 3學分
	TBBXB4B		
學系(門)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。			
學生基本能力			
<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. 具有國際化、資訊化、未來化之願景規劃基本能力。</p> <p>G. 具備審視國內外金融發展情勢之基本能力。</p> <p>H. 培訓學生獨立、因應及解決問題的基本能力。</p>			
課程簡介	<p>金融創新型態約有金融體制或機構創新、服務創新及產品創新三大類別。本課程主在介紹產品創新類別，使學生了解金融創新商品一般設計的原則、定價、在投資和風險管理上的應用及國內外各類金融創新商品發展概況；所涵蓋商品內容除了四大類基本的衍生性金融商品外，並介紹債券與股票之金融創新、結構債、資產證券化商品、信用衍生性商品等；同時透過個案研討，強化分析、應用甚至創新的能力。</p>		
	<p>Financial innovations are generally distinguished into three types: financial system/institutional innovations, process innovations and product innovations. This course mainly focuses on product innovations and exposes students to general design principles, pricing, applications on investment and risk management, and practices of financial product innovations domestic and abroad. In addition to four basic types of financial derivatives, the products covered in this course include bond and equity financial innovations, structure notes, securitization products, credit derivatives, etc.</p>		

本課程教學目標與目標層級、學生基本能力相關性

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」、「學生基本能力」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該系「學生基本能力」。單項教學目標若對應「學生基本能力」有多項時，則可填列多項「學生基本能力」(例如：「學生基本能力」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	學生基本能力
1	了解金融創新的緣起、發展、設計理念與基本架構	To understand the cause, development, design concepts, and overall structure of financial innovations.	C2	ABEF
2	熟稔各類金融創新商品之內涵、定價、用途與交易策略	To be proficient in the contents, pricing, usage, and trading strategies of various types of financial innovations.	P3	ABEF
3	分析與應用各類金融創新商品以形成更廣泛、周延之投資策略，因應金融環境的變動	To have the abilities to analyze and apply various financial innovation products to formulize broader or more comprehensive investing strategies and so as to response the fluctuation of financial environments.	A4	EFGH

教學目標之教學策略與評量方法

序號	教學目標	教學策略	評量方法
1	了解金融創新的緣起、發展、設計理念與基本架構	課堂講授、分組討論	出席率、報告、討論、小考、期中考
2	熟稔各類金融創新商品之內涵、定價、用途與交易策略	課堂講授、分組討論	出席率、報告、討論、小考、期中考、期末考
3	分析與應用各類金融創新商品以形成更廣泛、周延之投資策略，因應金融環境的變動	課堂講授、分組討論	出席率、報告、討論、小考、期中考、期末考

授課進度表

週次	日期	內容 (Subject/Topics)	備註

1	09/13	導論：金融創新的緣起、概況與發展	
2	09/20	四大類基本衍生性金融商品回顧：遠期契約與期貨	
3	09/27	四大類基本衍生性金融商品回顧：選擇權與交換	
4	10/04	新奇選擇權	
5	10/11	債券之金融創新	
6	10/18	股票之金融創新	
7	10/25	個案研討	
8	11/01	認購權證與可轉換證券之金融創新	
9	11/08	個案研討	
10	11/15	期中考試週	
11	11/22	結構債	
12	11/29	不動產證券化商品：MBS and REITs	
13	12/06	資產擔保證券(ABS)與擔保債務憑證(CDO)	
14	12/13	個案研討	
15	12/20	信用衍生性商品	
16	12/27	其他金融創新：與波動性、天氣、能源與保險等相關之衍生性商品	
17	01/03	個案研討	
18	01/10	期末考試週	
修課應 注意事項	修習此門課程同學應修過期貨與選擇權或衍生性金融商品，或對衍生性商品具備基本認識。		
教學設備	電腦、投影機		
教材課本	謝劍平，金融創新－財務工程的實務奧秘，智勝出版，2010年。		
參考書籍	Bookstaber, R., A Demon of Our Own Design: Markets, Hedge Funds, and the Perils of Financial Innovation, John Wiley & Sons Inc., 2008. Hull, J., Options, Futures, and Other Derivatives, Seventh Edition, Prentice Hall, 2008.		

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	<p>◆平時考成績：10.0 % ◆期中考成績：30.0 % ◆期末考成績：30.0 %</p> <p>◆作業成績： %</p> <p>◆其他〈個案研討專題報告〉：30.0 %</p>
備 考	<p>「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/index.asp/〉教務資訊「教學計畫 表管理系統」進入。</p> <p>※非法影印是違法的行為。請使用正版教科書，勿非法影印他人著作，以免觸法。</p>