

淡江大學 99 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	林蒼祥 Lin William T.
	SPECIAL TOPICS ON FINANCIAL ENGINEERING		
開課系級	財金二碩專班 A	開課 資料	必修 單學期 3學分
	TBBMJ2A		
學系(門)教育目標			
一、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。			
學生基本能力			
<p>A. 具備理論與實務融合應用之能力。</p> <p>B. 具備個案研究與分析的能力。</p> <p>C. 培養具備企業財務決策與分析之能力。</p> <p>D. 發展專業競爭的能力與態度。</p> <p>E. 強化溝通、協調與談判的能力。</p> <p>F. 提升財金研究理論與方法之素養。</p> <p>G. 提升考取高階財金專業證照之能力。</p> <p>H. 具有職場倫理與終身學習的精神。</p>			
課程簡介	本課程以深入淺出之方式，講解財務工程理論之財務涵義，並著重於實務，說明理論模型在交易策略、避險模型及新金融產品設計上之應用		
	This course introduces the financial meanings of financial engineering in a simple way. And it places importance on practical, illustrating the application on tradind, hedging and developing new financial products.		

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	使學生對財務工程有更進一步了解及應用	Make students understand financial engineering and its application in practical.	C4	ABCDEFH

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	使學生對財務工程有更進一步了解及應用	課堂講授、分組討論、參觀實習	討論、期中考、期末考

授課進度表

週次	日期	內容 (Subject/Topics)	備註
1	09/13	世界期貨市場競合	
2	09/20	財務工程的利基	
3	09/27	期貨特有成本模型及交易策略:Chap.4,個案(一)	
4	10/04	期貨避險及應用:Chap.5及Hull, Chap.3	
5	10/11	股價變動隨機模型:Chap.8	
6	10/18	ITO處理 Lognormal:Chap.8,個案(二)	
7	10/25	The B-S modal及歐式選擇權:Chap.8,個案(三)	
8	11/01	選擇權二項決策樹求解法及Black近似式(一):Chap.10	
9	11/08	期中考	

10	11/15	選擇權二項決策樹求解法及Black近似式(二):Chap.10	
11	11/22	選擇權交易策略及Greeks:Chap.7,9及補充教材(一)	
12	11/29	選擇權交易策略及Greeks:Chap.7,9及補充教材(二)	
13	12/06	市場風險值: Hull, Chap.18	
14	12/13	Swaps: Hull, Chap.7	
15	12/20	信用衍生商品:補充教材	
16	12/27	補充教材	
17	01/03	補充教材	
18	01/10	期末考試週	
修課應注意事項			
教學設備		(無)	
教材課本		林蒼祥等四人(2010), "期貨與選擇權:財務工程基礎理論與實務" 初版,前程文化	
參考書籍		Hull, J.(2006) "Options, Futures and other Derivatives", 6th ed.(双葉代理)	
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		◆平時考成績: % ◆期中考成績: 45.0 % ◆期末考成績: 45.0 % ◆作業成績: % ◆其他〈平時成績〉: 10.0 %	
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/index.asp/ 〉教務資訊「教學計畫表管理系統」進入。 ※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。	