

淡江大學 99 學年度第 1 學期課程教學計畫表

課程名稱	財務專題	授課教師	林志娟 Lin Jyh-jiuan
	SEMINAR IN FINANCIAL MANAGEMENT		
開課系級	統計一碩士班 A	開課資料	選修 單學期 3學分
	TMSXM1A		
學 系(門) 教 育 目 標			
一、培育學生具研究統計理論的能力。 二、培育學生具程式設計的能力。 三、培育學生成為具管理素養的統計專才。 四、培育學生具有國際視野。			
學 生 基 本 能 力			
A. 具研究統計理論的能力。 B. 具數據分析的能力。 C. 具撰寫程式的能力。 D. 具跨領域之知識的能力。 E. 具邏輯思考的能力。 F. 具良好的口語表達及文字溝通能力。 G. 具團隊合作能力。 H. 具統計諮詢能力。			
課程簡介	這門課的重點在於介紹如何從TEJ財金資料庫中汲取財金資料，並且介紹報酬率的定義，接著延伸回歸分析及時間數列相關預測模型在實務上之應用。另外介紹市場預測模型、基金績效及基金經理人則時能力之評估。同時介紹風險值之估計方法、模式適合度檢測及資金運用效率與巴塞爾協定等在風險管理中之應用。最後進行目前相關研究進展之研讀。建議能使用R、SAS或Fortran等相關軟體程式設計者修習較合宜。。		
	This course will introduce the data acquiring from the database TEJ and related statistical methods used in financial related fields' applications. It includes the commonly used market models and mutual funds' performance evaluations. We will also focus especially on the value-at-risk estimations and model validation and the capital efficiency in Basel Accord or the related topics in risk management.		

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	這門課首先介紹財金資料的汲取及統計方法在財務金融相關領域之運用；其中包含常用的市場預測模型、基金績效之評估，尤其是風險值之估計方法、模式適合度檢測及資金運用效率與巴塞爾協定等在風險管理中之應用，皆有深入之探討。	This course will familiarize students with the techniques of gaining the financial data from the database also extend the abilities of building a forecasting model using the regression analysis and time series methods. We will also discuss the commonly used market models, and mutual funds' performance evaluations, and value-at-risk estimations and the recently developed methods in the research papers.	C5	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	這門課首先介紹財金資料的汲取及統計方法在財務金融相關領域之運用；其中包含常用的市場預測模型、基金績效之評估，尤其是風險值之估計方法、模式適合度檢測及資金運用效率與巴塞爾協定等在風險管理中之應用，皆有深入之探討。	課堂講授	出席率、報告、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	Definition of the Rate of Return and Financial Data Base	
2	09/20	Application of forecasting model in Finance-1	

3	09/27	Application of forecasting model in Finance-2	
4	10/04	The Capital Asset Pricing Model	
5	10/11	Portfolio Performance Measurement-1	
6	10/18	Portfolio Performance Measurement-2	
7	10/25	Value-at-Risk Definition	
8	11/01	Value-at-Risk Estimation Methods-1	
9	11/08	Value-at-Risk Estimation Methods-2	
10	11/15	Midterm	
11	11/22	Value-at-Risk Estimation Methods-3	
12	11/29	Value-at-Risk Estimation Methods - the Model Adequacy Checking	
13	12/06	Value-at-Risk Estimation Methods - the Capital Efficiency and the Basel Accord	
14	12/13	Research Papers Discussion-1	
15	12/20	Research Papers Discussion-2	
16	12/27	Research Papers Discussion-3	
17	01/03	Research Papers Discussion-4	
18	01/10	Final	
修課應 注意事項		請嚴守學生上課基本紀律，並應按時繳交作業以免影響成績。 建議能使用R、SAS或Fortran等相關軟體程式設計者修習較合宜。	
教學設備		電腦、投影機	
教材課本		Class Supplementary Reading	
參考書籍		PHILIPPE JORION (2007), "VALUE AT RISK", 3rd Edition, Mc Graw Hill, 新月代理。 Financial Risk Manager Handbook(金融風險管理), 5th edition, 作者: PHILIPPE JORION, John Wiley & Sons, Inc., 新月代理。 財金計量, 鍾惠民、吳壽山、周賓鳳、范懷文等合著, 雙葉出版。	

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：30.0 % ◆期中考成績：35.0 % ◆期末考成績：35.0 % ◆作業成績： % ◆其他〈 〉： %
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。