

淡江大學 99 學年度第 2 學期課程教學計畫表

課程名稱	財務工程研討	授課 教師	吳佩珊 Pei-shan Wu
	FINANCIAL ENGINEERING SEMINAR		
開課系級	財金進學班三A	開課 資料	選修 單學期 2學分
	TBBXE3A		
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	本課程結合投資學、衍生性金融商品、期貨與選擇權、財務工程與金融創新等課程之實務操作，引導學生將資訊管理能力應用在金融之專業領域。		
	This course will integrate the practice operation of Investment, Derivatives, Futures and Options, Financial Engineering and Financial Innovation. This course will lead students to have the ability to manage information, and further to apply in professional finance field.		

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	1. 建構評價函數與表單系統 2. 以二元樹方式評價選擇權 3. 程式交易 4. 金融創新產品探討	1. To establish the pricing functions and form systems. 2. Pricing option by binomial tree model. 3. System trading 4. The products of financial innovation	P3	AFH

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	1. 建構評價函數與表單系統 2. 以二元樹方式評價選擇權 3. 程式交易 4. 金融創新產品探討	課堂講授	出席率、小考、期中考、期末考

授課進度表

週次	日期起訖	內容 (Subject/Topics)	備註
1	100/02/14~ 100/02/20	課程介紹	
2	100/02/21~ 100/02/27	以VBA撰寫自建函數	
3	100/02/28~ 100/03/06	以VBA撰寫財務函數	
4	100/03/07~ 100/03/13	以Black-Scholes公式評價選擇權買賣權	
5	100/03/14~ 100/03/20	以Black-Scholes公式評價選擇權避險參數	
6	100/03/21~ 100/03/27	以二項式模型評價選擇權買賣權(JR,CRR)	
7	100/03/28~ 100/04/03	以二項式模型評價選擇權買賣權(JR,CRR)-表單實作	

8	100/04/04~ 100/04/10	以VBA程式碼求解隱含波動率	
9	100/04/11~ 100/04/17	以繪圖分析影響選擇權價格的因素	
10	100/04/18~ 100/04/24	期中考試週	
11	100/04/25~ 100/05/01	以蒙地卡羅模擬方法評價選擇權(1)	
12	100/05/02~ 100/05/08	以蒙地卡羅模擬方法評價選擇權(2)	
13	100/05/09~ 100/05/15	選擇權避險(1)	
14	100/05/16~ 100/05/22	選擇權避險(2)	
15	100/05/23~ 100/05/29	選擇權交易策略(1)	
16	100/05/30~ 100/06/05	選擇權交易策略(2)	
17	100/06/06~ 100/06/12	保本型商品與高收益商品分析	
18	100/06/13~ 100/06/19	期末考試週	
修課應 注意事項			
教學設備	電腦、投影機		
教材課本	《期貨與選擇權：財務工程基礎理論與實務》 ISBN:9866264149 前程企管 林蒼祥；蔡蒔銓；孫效孔；邱文昌		
參考書籍	《金融資訊管理：分析與系統設計》 ISBN:9867260821 新陸經銷 姜林杰祐		
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：30.0 % ◆期末考成績：30.0 % ◆作業成績： % ◆其他〈出席〉：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。		