

朝陽科技大學
107學年度第2學期教學大綱

當期課號	7017	中文科名	財務工程專題
授課教師	張阜民	開課單位	財務金融系
學分數	2	修課時數	2
		開課班級	日間部碩士班1年級 A班
修習別	專業選修		
類別	一般課程		

本課程培養學生下列知識：

本課程對於財務工程相關議題，先闡述數學及統計原理，討論其實際應用意義，並藉由Excel VBA 程式化來幫助學生對此領域的了解。

- 1.熟悉財務數學
- 2.熟悉選擇權
- 3.熟悉數值分析
- 4.熟悉奇異選擇權
- 5.熟悉波動微笑

Financial engineering involves the design, the development, and the implementation of innovative financial instruments and process, and the formulation of creative solutions to problems in finance. For the related topics about financial engineering, we first involve the fundamental theories and methods, apply coding with Excel VBA, and then discuss their implementation in practical applications.

每週授課主題

- 第01週：課程簡介。本學期課程安排與內容規劃
- 第02週：報酬與風險
- 第03週：報酬與風險
- 第04週：投資組合之風險
- 第05週：投資組合之風險
- 第06週：投資組合之風險
- 第07週：最低風險組合
- 第08週：最低風險組合
- 第09週：期中考
- 第10週：有險資產與無險資產之最低風險組合
- 第11週：有險資產與無險資產之最低風險組合
- 第12週：R 語言
- 第13週：R 語言
- 第14週：R 語言
- 第15週：R 語言
- 第16週：R 語言
- 第17週：R 語言
- 第18週：期末考

成績及評量方式

- 期中考：35%
- 期末考：35%
- 平時作業及出席：30%

證照、國家考試及競賽關係

本課程無證照、國家考試及競賽資料。

主要教材

- 1.財務工程葉芳柏全華(教科書)

參考資料

本課程無參考資料!

建議先修課程

本課程無建議先修課程

教師資料

教師網頁：<http://www.cyut.edu.tw/~fmchang/>

E-Mail：fmchang@cyut.edu.tw

Office Hour：

星期二,第3~4節,地點:T2-912;

星期四,第3~4節,地點:T2-912;

分機:4488

[\[關閉\]](#) [\[列印\]](#)

尊重智慧財產權，請勿不法影印。