

「碩士班財務工程」學程簡介

102 學年度第 2 學期整合學程會議修訂通過
93.12.03 整合學程會議修訂通過
93.12.06 九十三學年度第三次系務會議修訂通過
96.10.08 96 學年度第 1 次系務會議修訂通過
96.11.15 96 學年度第 1 學期整合學程會議

一、學程目的

本學程旨在提升我國財務工程相關之研究與教學，並儲備未來之財務工程人才。

二、發展重點與特色

本學程之設計旨在教導學生對衍生性金融商品訂價模式的理論背景有良好的認識，更重要的是讓學生能真正了解不同模式的假設條件、適用性及限制條件。本學程有一部份內容會檢視在不同市場情況下模式的行為會如何表現，探討假設條件之真實性，並了解假設條件改變則將會發生何種結果，學生將學習使用模式作避險，並評估在不同市場條件下，這些避險方法的有效性。

本學程之內容包括數學、統計、經濟及財務四個領域，數學與統計相關課程由應數系提供，經濟相關課程由經研所提供，財務相關課程由財管系提供。本學程將教導學生如何使用電腦模擬來闡釋課題，其目的在訓練學生能在每一階段應用所學之理論。

- 1、財務工程計劃之要求：學生除至少修滿學程內二十學分之課程外，尚必須要求完成一件最終計劃，可能是一件團隊計劃，將其所學展現在此一計劃上。
- 2、全國首創之碩士班財務工程學程：今年起國內衍生性金融商品將陸續上市，在可預見的未來此類人才之需求極為殷切。目前國內只有清大經濟系成立計量財務組，需四年後學生才能畢業。本學程為全國首創之碩士班財務工程學程，將對有數理、經濟或財務背景之研究生施以嚴格的財務工程相關訓練，於兩年後即可進入就業市場。因此，本校可在財務工程領域奠定開路先峰的地位。

三、實施對象：本校在學之研究所碩士班學生。

四、課程系統

- 1、本學程至少應修滿 20 學分。
- 2、選修「財務工程」學程之應修學分可計算於畢業學分內。
- 3、管理數學為大學部課程，不計算在本學程之學分。
- 4、選讀學程之學生，所修習之學程課程中，至少應有九學分不屬於學生本系所、雙主修及輔系之課程（請進入教務處-註冊組網頁詳看整合學程

之規定)。

5、修完本學程規定科目、學分，畢業時，可依本校相關規定申請核發學程證書。

五、學程開始日期：八十六學年度。

六、申請日期：依照學校行事曆規定日期申請修讀本學程。

七、申請程序

請向原就讀科系提出申請，由各系彙整申請名單及已修課成績單送交學程主持人，經彙整審核資格同意後，彙整送教學發展中心，送教務長核准。

八、學程課程一覽表

	開課單位	課程名稱	學分數	備註
核 心 課 程	機電系	工程數學（一）或（二）	0	大學部課程
	財管系	財務工程	3	博士班課程
	應數系	數理統計	3	碩士班課程
	核心課程學分數：6 學分			
選 修	財管系	選擇權市場理論與策略	3	碩士班課程
	財管系	投資理論與策略	3	碩士班課程
	財管系	證券市場微結構實務	3	碩士班課程
	財管系	金融機構風險管理	3	碩士班課程
	財管系	國際投資組合管理	3	碩士班課程
	財管系	現代投資組合理論與策略	3	碩士班課程
	財管系	財務經濟學（一）	3	博士班課程
	財管系	計量經濟學（一）	3	博士班課程
	財管系	財務經濟理論與實證	3	碩士班課程
	應數系	財務時間序列分析	3	碩士班課程
	經研所	計量經濟學	3	碩士班課程
總學分數：至少 20 學分				

九、學程諮詢服務：財務管理學系系主任，分機：4800。

十、網頁網址：http://www.finance.nsysu.edu.tw/master_engi.htm

修訂之內容溯及至九十四學年度第一學期之申請通過者