

## 南台科技大學 98 學年度第 2 期課程資訊

課程名稱	財務模型專題研討
課程編碼	80M02301
系所代碼	08
開課班級	碩研財金一甲
開課教師	何啟銘
學分	3.0
時數	3
上課節次地點	二 2 3 4 教室 S404
必選修	選修
課程概述	本課程主要介紹相關財金研究方法論，除了常見的迴歸分析外，另外再加入事件研究法、模擬、信用評等以及財務工程等相關議題，為了配合前述議題的延伸，指定學生分組研讀相關文獻並提出看法，俾使學生在瞭解理論的同時也能夠學習關鍵技術以及發展成論文题目的可能性。
課程目標	運用計量經濟學與統計方法，探討財金議題。例如：GARCH 模型、CAPM、共同基金擇時能力，以及事件研究法等。
課程大綱	<p>課程簡介與基礎統計分析</p> <p>統計檢定</p> <p>進階迴歸分析</p> <p>虛擬變數應用</p> <p>資本資產定價理論</p> <p>資本資產定價理論應用</p> <p>事件研究法(1)</p> <p>事件研究法(2)</p> <p>期中考（報告）</p> <p>信用評等</p> <p>信用風險</p> <p>風險值(1)</p> <p>風險值(2)</p> <p>模擬-布朗運動</p> <p>模擬-Ito 隨機過程</p> <p>隱含波動率</p> <p>Black-Scholes 方程式</p>
英文大綱	
教學方式	
評量方法	

指定用書	
參考書籍	
先修科目	
教學資源	
注意事項	
全程外語授課	0
授課語言 1	華語
授課語言 2	
輔導考照 1	
輔導考照 2	