



附件一 金融工程師認證培訓班課程簡章

◆ 課程源起

隨著金融市場的大幅變化，金融自由化浪潮席捲全球的同時，促進了衍生性金融市場的快速發展。資產管理加入了各類的新商品，投資工具也更加的多元化，金融工程儼然成為金融領域中一門新興學科。金融工程的發展使衍生性金融商品、風險值(VaR)等風險管理技術的不斷提升，金融創新與風險管理的專業人員需求急速增加。

台灣金融工程師學會針對銀行、投資銀行、基金管理、衍生性金融商品與風險管理等領域之專業人員，提供本項專業進修之培訓課程，藉由金融工程技術協助業者發展創新金融商品、擬定交易策略與風險管理系統、評估公司之一切金融和財務的風險，提供結構化的解決方案和風險管理，結合本會認證制度，為金融機構培訓具有完整金融工程知識及技術，並具備國際化視野的金融工程實務操作之專業人才。

◆ 認證目的

經專業認證之金融工程師可以藉由金融工程技術提高金融效率，對於各種金融商品的計算與了解，可從包羅萬象的數理觀點，產生更廣闊的專業視野，創造自己就業、升遷、轉職及加薪的機會。

在管理方面，金融工程師可替金融機構可進行資產負債管理和風險管理，決策機制和執行機制之結合，使決策效益增強，並提供客戶更完整的財務規劃。



◆ 認證特色

本學會正積極與上海交通大學及香港金融工程師協會等金融工程權威組織討論建構兩岸三地金融工程平台，著眼於大中華地區的專業技術整合，將大大增加本次認證未來運用的廣度。

◆ 課程特色

1. 涵蓋金融工程理論與實務應用
2. 講師群涵蓋各大學著名金融系教授及業界資深專業主管
3. 假日上課，便於在職人士深造進修
4. 認證與培訓結合,有利於專業及權威之建立
5. 全國唯一培訓金融創新人才之搖籃

◆ 培訓對象：

1. 金融業之從業人員
2. 欲進入金融行業或轉換跑道之社會人士
3. 對金融工程師課程有興趣之人士

◆ 培訓期間及上課地點

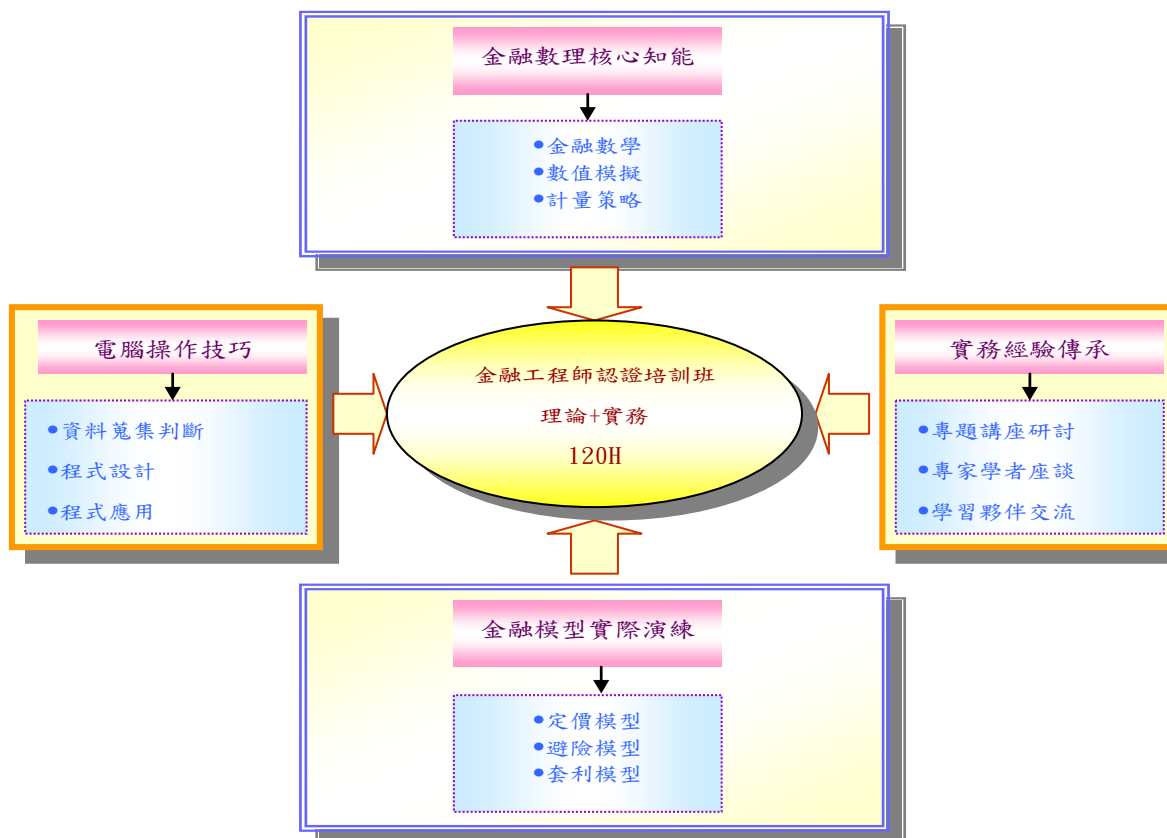
1. 上課日期：100年9月16日~101年1月7日。
2. 上課時數：120小時，40單元。
3. 上課時間：星期五晚上 19:00~22:00，星期六上午 9:00~12:00，星期六下午 14:00~17:00
4. 上課地點：政治大學公企中心、恆逸資訊教育訓練中心



◆ **報名資格**：大專院校畢業，對初級微積分、初級統計學有基礎者。

◆ **課程目標**

加入本班，您將快速擁有





◆ 課程費用：全程 NT\$ 60,000 元 (含教材、講義與茶水)

學生收費 NT\$ 42,000 元

會員收費 NT\$ 45,000 元

早鳥報名(2011/9/5 之前) NT\$ 48,000 元

◆ 課程內容：(本會保有課程異動及講師調整之權利)

金融工程師證照培訓班課程表				
A1 金融工程數學				
課程內容	時數/堂	上課日程		講師
機率理論	3	2011/9/16	19:00~22:00	王昭文 (高雄第一科大風險管理與保險系 副教授)
隨機過程	3	2011/9/17	9:00~12:00	王昭文 (高雄第一科大風險管理與保險系 副教授)
Ito's 公式	3	2011/9/17	14:00~17:00	王昭文 (高雄第一科大風險管理與保險系 副教授)
平賭過程評價法	3	2011/9/23	19:00~22:00	林士貴 (政大金融學系 副教授)
測度轉換	3	2011/9/24	9:00~12:00	林士貴 (政大金融學系 副教授)
金融商品評價技巧 I	3	2011/9/30	19:00~22:00	廖四郎 (政大金融系 教授)
進階金融商品評價技巧 II	3	2011/10/1	9:00~12:00	廖四郎 (政大金融系 教授)
金融商品評價實務座談	3	2011/10/1	14:00~17:00	主持人:廖四郎
共計 8 堂 24 小時				
A2 金融計量				



課程內容	時數/堂	上課日程		講師
VBA 程式基礎	3	2011/10/14	19:00~22:00	姜林杰祐 (高雄應用科大金融系 教授)
VBA 程式設計與應用	3	2011/10/15	9:00~12:00	姜林杰祐 (高雄應用科大金融系 教授)
VBA 範例講解	3	2011/10/15	14:00~17:00	姜林杰祐 (高雄應用科大金融系 教授)
蒙地卡羅模擬 I	3	2011/10/22	9:00~12:00	韓傳祥 (清大計量財務金融學系 副教授)
蒙地卡羅模擬 II	3	2011/10/22	14:00~17:00	韓傳祥 (清大計量財務金融學系 副教授)
平面樹及立體樹的建構理論及應用 I	3	2011/10/29	9:00~12:00	戴天時 (交大資訊與財金管理學系 副教授)
平面樹及立體樹的建構理論及應用 II	3	2011/10/29	14:00~17:00	戴天時 (交大資訊與財金管理學系 副教授)
波動率內涵與交易實務 (VIX)I	3	2011/10/28	19:00~22:00	陳威光 (政大金融系 教授)
波動率內涵與交易實務 (VIX)II	3	2011/11/4	19:00~22:00	陳威光 (政大金融系 教授)
迴歸分析	3	2011/9/24	14:00~17:00	李沃牆 (淡江財務金融學系教授)
時間序列	3	2011/10/21	19:00~22:00	李沃牆 (淡江財務金融學系教授)
類神經網路與人工智慧 I	3	2011/11/5	9:00~12:00	林萍珍 (高雄應用科大金融系 副教授)
類神經網路與人工智慧 II	3	2011/11/5	14:00~17:00	柯博昌 (高雄應用科大資管系 教授)
交易策略實務座談	3	2011/11/11	19:00~22:00	主持人:廖四郎
期中考試	3	2011/11/18	19:00~22:00	
共計 15 堂 45 小時				
B1 金融工程理論模型(期貨與選擇權)				



課程內容	時數/堂	上課日程		講師
固定收益證券與利率模型	3	2011/11/12	9:00~12:00	蔡宏彬 (凱基證券風管部)
債券衍生性商品評價	3	2011/11/12	14:00~17:00	蔡宏彬 (凱基證券風管部)
信用衍生性商品評價	3	2011/11/19	9:00~12:00	江彌修 (政大金融系 副教授)
金融商品風險管理 I	3	2011/11/25	19:00~22:00	廖四郎 (政大金融系 教授)
金融商品風險管理 II	3	2011/11/26	9:00~12:00	廖四郎 (政大金融系 教授)
風險控管實務座談	3	2011/11/26	14:00~17:00	主持人:廖四郎
共計 6 堂 18 小時				
C1 金融工程實務應用(期貨與選擇權)				
課程內容	時數/堂	上課日程		講師
金融道德	3	2011/11/19	14:00~17:00	江永裕 (政大金融系 教授)
程式及高頻交易	3	2011/12/2	19:00~22:00	姜樹宇 (太渥資產管理公司執行長)
Trade station Easy/Power Language 語法基礎	3	2011/12/9	19:00~22:00	鄒心凱 (永豐期貨)
Trade station 交易策略的構思到成形	3	2011/12/10	9:00~12:00	鄒心凱 (永豐期貨)
Trade station 範例講解	3	2011/12/10	14:00~17:00	鄒心凱 (永豐期貨)
MultiCharts	3	2011/12/16	19:00~22:00	張林忠 (元大期貨 分析師)
MultiCharts	3	2011/12/17	9:00~12:00	張林忠 (元大期貨 分析師)
MultiCharts 範例講解	3	2011/12/17	14:00~17:00	張林忠 (元大期貨 分析師)
計量化投資策略 I	3	2011/12/3	9:00~12:00	鄭義 (中山財務管理學系 副教授)
計量化投資策略 II	3	2011/12/3	14:00~17:00	鄭義 (中山財務管理學系 副教授)



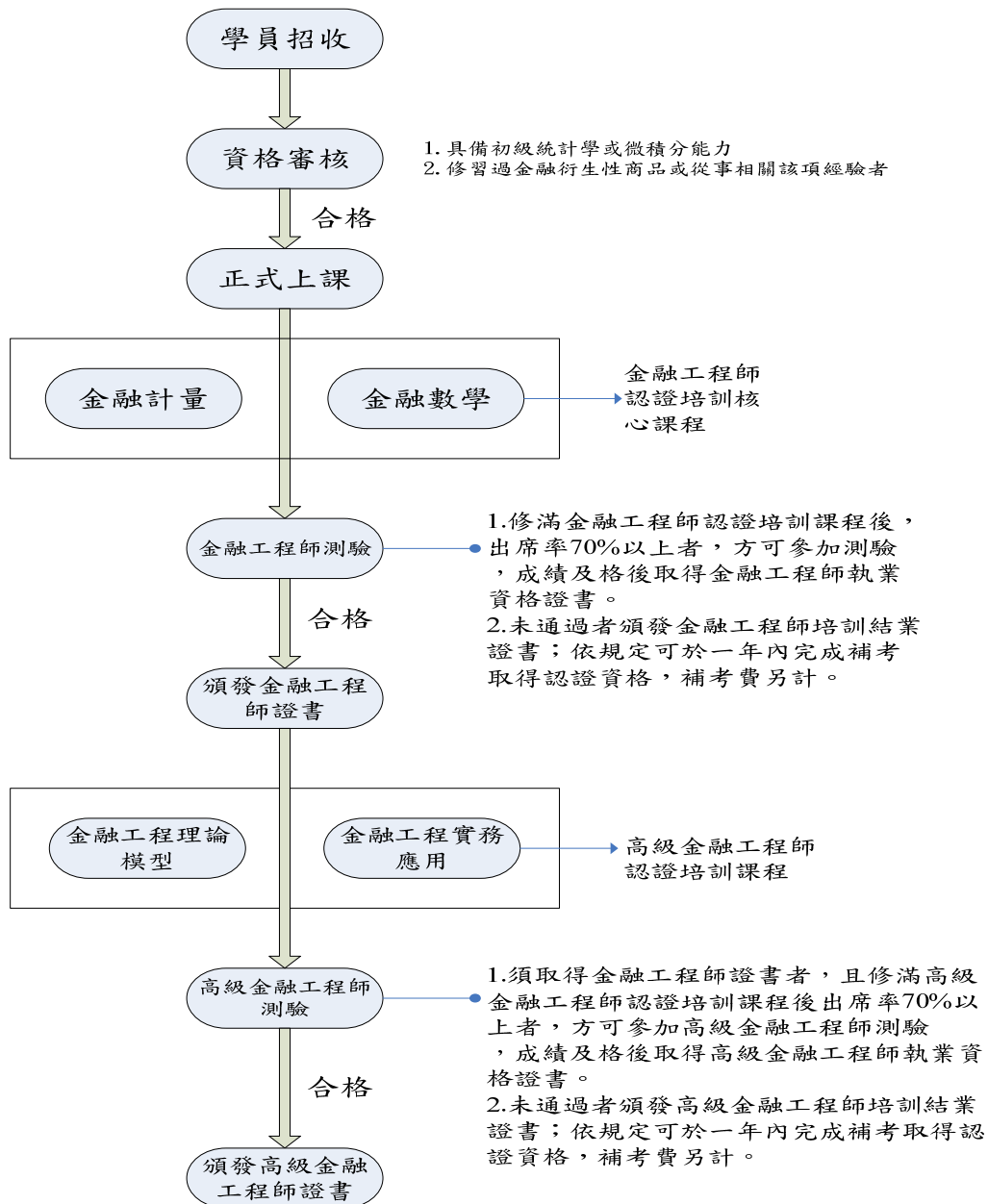
台灣金融工程師學會

避險基金操作原理原則	3	2012/1/7	9:00~12:00	林彥全 (康和期經)
金融工程發展趨勢實務座談	3	2012/1/7	14:00~17:00	主持人:廖四郎
期末考試	3	2012/1/13	19:00~22:00	
共計 13 堂 39 小時				
總計 42 堂 126 小時(包含期中、期末考)				

116 臺北市文山區指南路二段 64 號
政治大學商學院金融工程研究中心
TEL: (02)8661-7079
FAX: (02)8661-0401
WEB SITE: www.TAFE.org.tw



◆ 培訓及認證流程





台灣金融工程師學會

◆ 服務專線

報名問題專線:

黃于瑄秘書，電話：(02)8661-7079、0919606435，

E-mail: cafie@neeu.edu.tw。

課程問題專線:

黃柏翔主任，電話：(02)8661-7079、0919286547，

E-mail: shang@gcprm.com。

傳真熱線 02-86610401

◆ 繳費方式(網路報名後將會提供繳費帳號資料等)

匯款帳戶	台灣金融工程師學會
郵政劃撥帳號	19615490
金融機構匯款	167-10-122513 第一銀行 木柵分行 (007)

◆ 報名方式及地點

網路報名:<http://www.tafe.org.tw/>

116 臺北市文山區指南路二段 64 號

政治大學商學院金融工程研究中心

TEL: (02)8661-7079

FAX: (02)8661-0401

WEB SITE: www.TAFE.org.tw