

(八) 國立政治大學「財務工程」博士班學程

100 年 1 月 11 日

壹、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，儲備未來優秀財務工程人才，並鼓勵相關科系優秀學生參與財務工程之研習。

貳、實施對象：

本校在學之研究所博士班學生。

參、課程系統

(一) 博士班學生在本學程內至少應修滿必修課程 24 學分，選修課程 12 學分，共計 36 學分。

(二) 「財務工程」學程課程一覽表

數學課程	課程名稱	必/選修	學分數
數學課程 必修 3 學分	● 實變函數論(一) (Real Analysis(1))	必	3
	● 數值方法(一) (Numerical Methods(1))	選	3
	● 實變函數論(二) (Real Analysis(2))	選	3
	● 數值方法(二) (Numerical Methods(2))	選	3
	● 微分方程式 (Differential Equation)	選	6
統計課程 必修 3 學分	● 機率論或數理統計(一) (Probability or Mathematical Statistics(1))	必	3
	● 數理統計(二) (Mathematical Statistics(2))	選	3
	● 隨機過程 (Stochastic Process)	選	3
	● 高等數理統計學 (Advanced Mathematical Statistics)	選	6
經濟課程 必修 3 學分	● 計量經濟或時間序列(碩士班以上)	必	3
	● 經濟學(大學部以上)或個體經濟學 (大學部以上)或總體經濟學(大學部 以上) 三選一	必	3(學分不計)
財務管理課程 必修 3 學分	● 財務管理(或財務經濟學)(大學部以 上)	必	3
	● 投資學(大學部以上)	選	3
財務工程課程 必修 12 學分	● 金融衍生性商品(或選擇權-評價與 應用)	必	3
	● 財務數學(一)	必	3
	● 財務工程數值方法	必	3

	<ul style="list-style-type: none"> ● 金融風險管理 ● 財務工程及金融創新 ● 高等財務管理 ● 投資學或證券投資等相關課程 	必 選 選 選	3 3 3 3
風管課程	<ul style="list-style-type: none"> ● 壽險數學 ● 產險精算 ● 精算數學專題 	選 選 選	3 3 3

肆、學程開始日期：

九十九學年度九月起。

伍、證明書申請日期：

博士班必須於每年四月底前向應數系提出申請。

陸、證明書申請程序：

凡修畢該學程之碩士生，經本學程委員會審查後，提交商學院確認。

柒、修滿財務工程學程 30 學分的碩士生將獲得本校商學院及財務工程暨衍生性金融商品研究中心須給授業完成證明書。

捌、學程委員會：

(一) 本委員會設置召集人一名，由財務工程中心主任兼任之。

(二) 委員會由召集人聘請財務工程相關領域教授及相關系所主任或其所推薦之教授組成。