

淡江大學 100 學年度第 1 學期課程教學計畫表

課程名稱	風險管理	授課 教師	李沃牆 Lee, Wo-chiang
	RISK MANAGEMENT		
開課系級	財金一博士班 A	開課 資料	選修 單學期 3學分
	TBBMD1A		
系 所 教 育 目 標			
紮實的財務理論基礎與嚴謹的研究方法，培養具國際視野與獨立研究能力之學術人才。			
系 所 核 心 能 力			
A. 奠定紮實的財務金融理論基礎。 B. 整合跨領域理論與實務的應用能力。 C. 熟稔相關財金研究方法與成果。 D. 具備獨立研究的學術能力。 E. 提升學生的教學能力。 F. 提升學術研究國際化之能力。			
課程簡介	讓修課學生能夠瞭解風險管理基本觀念,進而探討市場風險,信用風險,與作業風險		
	Let the students can understand the concept of risk management, further to discuss the market risk, credit risk and operational risk.		

本課程教學目標與目標層級、系所核心能力相關性

一、目標層級(選填)：

- (一)「認知」(Cognitive 簡稱C)領域：C1 記憶、C2 瞭解、C3 應用、C4 分析、C5 評鑑、C6 創造
- (二)「技能」(Psychomotor 簡稱P)領域：P1 模仿、P2 機械反應、P3 獨立操作、P4 聯結操作、P5 自動化、P6 創作
- (三)「情意」(Affective 簡稱A)領域：A1 接受、A2 反應、A3 重視、A4 組織、A5 內化、A6 實踐

二、教學目標與「目標層級」、「系所核心能力」之相關性：

- (一)請先將課程教學目標分別對應前述之「認知」、「技能」與「情意」的各目標層級，惟單項教學目標僅能對應C、P、A其中一項。
- (二)若對應「目標層級」有1~6之多項時，僅填列最高層級即可(例如：認知「目標層級」對應為C3、C5、C6項時，只需填列C6即可，技能與情意目標層級亦同)。
- (三)再依據所訂各項教學目標分別對應該系「系所核心能力」。單項教學目標若對應「系所核心能力」有多項時，則可填列多項「系所核心能力」(例如：「系所核心能力」可對應A、AD、BEF時，則均填列)。

序號	教學目標(中文)	教學目標(英文)	相關性	
			目標層級	系所核心能力
1	具備財務風險理論與實務的基本知識	With financial risk theory and practice knowledge	C2	ABCD
2	增進風險管理的知識	Advanced knowledge in risk management.	C2	AD
3	增進對市場風險,信用風險,作業風險的分析能力	Enhanced analytic capability in market risk, credit risk and operational risk.	P3	ABCD

教學目標之教學策略與評量方法

序號	教學目標	教學策略	評量方法
1	具備財務風險理論與實務的基本知識	課堂講授、分組討論	出席率、報告、討論
2	增進風險管理的知識	課堂講授、分組討論	出席率、報告、討論
3	增進對市場風險,信用風險,作業風險的分析能力	課堂講授、分組討論	出席率、報告、討論

本課程之設計與教學已融入下列本校基本素養與核心能力

淡江大學基本素養與核心能力	內涵說明
◇ 表達能力與人際溝通	有效運用中、外文進行表達，能發揮合作精神，與他人共同和諧生活、工作及相處。
◆ 科技應用與資訊處理	正確、安全、有效運用資訊科技，並能蒐集、分析、統整與運用資訊。
◆ 洞察未來與永續發展	能前瞻社會、科技、經濟、環境、政治等發展的未來，發展與實踐永續經營環境的規劃或行動。
◇ 學習文化與理解國際	具備因應多元化生活的文化素養，面對國際問題和機會，能有效適應和回應的全球意識與素養。
◆ 自我了解與主動學習	充分了解自我，管理自我的學習，積極發展自我多元的興趣和能力，培養終身學習的價值觀。
◆ 主動探索與問題解決	主動觀察和發掘、分析問題、蒐集資料，能運用所學不畏挫折，以有效解決問題。
◇ 團隊合作與公民實踐	具備同情心、正義感，積極關懷社會，參與民主運作，能規劃與組織活動，履行公民責任。
◇ 專業發展與職涯規劃	掌握職場變遷所需之專業基礎知能，管理個人職涯的職業倫理、心智、體能和性向。

授 課 進 度 表

週次	日期起訖	內 容 (Subject/Topics)	備 註
1	100/09/05~ 100/09/11	Introduction(Chapters 1) What is risk? Risk management?	
2	100/09/12~ 100/09/18	Financial Products and how they are used for hedging,Portfolio analysis (Chapters 2) (Exercise 1)	
3	100/09/19~ 100/09/25	How traders manage their exposures	
4	100/09/26~ 100/10/02	Market Risk-Volatility (Chapter 5) (Exercise 3)	
5	100/10/03~ 100/10/09	Bank Regulation and Basel II (Chapter 7)	
6	100/10/10~ 100/10/16	Market Risk-VaR Model((Chapter 8)	
7	100/10/17~ 100/10/23	Market Risk-VaR Model-(Chapter 9)-(Exercise 4)	
8	100/10/24~ 100/10/30	1 Market Risk-VaR Model-.Extreme value theory(Ch9)	
9	100/10/31~ 100/11/06	Credit Risk: Estimating Default Probabilities	
10	100/11/07~ 100/11/13	期中考試週(Midterm)	
11	100/11/14~ 100/11/20	Credit Risk: Estimating Default Probabilities	
12	100/11/21~ 100/11/27	Credit Risk: Estimating Default Probabilities	

13	100/11/28~ 100/12/04	Credit Derivatives (Chapter 13)	
14	100/12/05~ 100/12/11	Correlation and Copula(Chapter 6-2)	
15	100/12/12~ 100/12/18	Operational Risk (Chapter 14)-1	
16	100/12/19~ 100/12/25	Operational Risk (Chapter 14)-2	
17	100/12/26~ 101/01/01	Data Mining in Credit Risk-Introduction	
18	101/01/02~ 101/01/08	期末考試週(Final Exam)	
修課應 注意事項			
教學設備		電腦	
教材課本		1. John Hull(2010), Risk Management and Financial Institutions , 2nd, Pearson Prentice Hall(雙葉書局代理) 2 Lee,Wo-Chiang(2010),Lecture Note	
參考書籍		3 Philippe Jorion(2007),Value at Risk,3nd,Mcgraw Hill (新月代理)	
批改作業 篇數		篇 (本欄位僅適用於所授課程需批改作業之課程教師填寫)	
學期成績 計算方式		◆平時考成績：20.0 % ◆期中考成績： % ◆期末考成績： % ◆作業成績： 40.0 % ◆其他〈報告, term paper〉：40.0 %	
備 考		「教學計畫表管理系統」網址： http://info.ais.tku.edu.tw/csp 或由教務處 首頁〈網址： http://www.acad.tku.edu.tw/index.asp/ 〉教務資訊「教學計畫 表管理系統」進入。 ※非法影印是違法的行為。請使用正版教科書，勿非法影印他人著作，以免觸法。	