

淡江大學 100 學年度第 2 學期課程教學計畫表

課程名稱	財務風險個案	授課 教師	李沃牆 LEE, WO-CHIANG
	FINANCIAL RISK-CASE STUDY		
開課系級	財金二碩專班 A	開課 資料	選修 單學期 3學分
	TBBMJ2A		
系 (所) 教育目標			
提供財務金融產業人才之專業訓練課程，以落實實務與理論融合應用之能力。			
系 (所) 核心能力			
<p>A. 具備理論與實務融合應用之能力。</p> <p>B. 具備個案研究與分析的能力。</p> <p>C. 培養具備企業財務決策與分析之能力。</p> <p>D. 發展專業競爭的能力與態度。</p> <p>E. 提升財金研究理論與方法之素養。</p> <p>F. 提升考取高階財金專業證照之能力。</p>			
課程簡介	<p>本課程由風險管理的觀念著手，分別介紹市場風險、信用風險及作業風險的理論與模型、再透過國內外近幾年較為有名的財務風險個案進行分組討論，可讓學生瞭解風險的重要性及避險的必要性。</p>		
	<p>The course first introduce the basic risk concepts, include the market risk ,credit risk and operation risk theory and models. We also to discuss the famous financial crisis cases. Students will understand the importance of risk and the necessity of hedging.</p>		

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其「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	具備財務風險管理觀念	With financial risk knowledge	C2	ABCF
2	具備財務風險分析能力	With the analytic capability of financial risk	C4	BCE
3	提升財務風險管理能力	Enhanced the management capability of financial risk	C4	CDE

教學目標之教學方法與評量方法

序號	教學目標	教學方法	評量方法
1	具備財務風險管理觀念	講述、討論	報告、上課表現
2	具備財務風險分析能力	講述、討論	報告、上課表現
3	提升財務風險管理能力	講述、討論	報告、上課表現

本課程之設計與教學已融入本校校級基本素養與核心能力

淡江大學校級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	101/02/13~ 101/02/19	課程介紹	
2	101/02/20~ 101/02/26	風險管理概述、分組報告說明	
3	101/02/27~ 101/03/04	新版巴塞爾協定與金融風險管理	
4	101/03/05~ 101/03/11	市場風險概述與風險值定義;投信的市場風險管理模式	
5	101/03/12~ 101/03/18	風險值模型與實作(1)	
6	101/03/19~ 101/03/25	風險值模型與實作(2)	
7	101/03/26~ 101/04/01	(1)風險值模型與實作(3)財務風險個案1:	
8	101/04/02~ 101/04/08	(1)利率風險與資產負債管理(1)(2)財務風險個案2:	
9	101/04/09~ 101/04/15	(1)利率風險與資產負債管理(2)(2)財務風險個案3:	
10	101/04/16~ 101/04/22	期中考	
11	101/04/23~ 101/04/29	(1)信用風險與違約機率;投信的信用風險管理模式(2)財務風險個案4:	
12	101/04/30~ 101/05/06	(1)信用風險模型與實作(1) (2)財務風險個案6:	

13	101/05/07~ 101/05/13	(1)信用風險模型與實作(2) (2)財務風險個案7:	
14	101/05/14~ 101/05/20	(1)資產組合之信用風險評估與實作(2)財務風險個案8:	
15	101/05/21~ 101/05/27	(1)作業風險與評估;投信的作業,內控風險管理模式(2)財務風險個案9:	
16	101/05/28~ 101/06/03	(1)作業風險與評估;投信的作業,內控風險管理模式(2)財務風險個案10:	
17	101/06/04~ 101/06/10	(1)作業風險與評估;投信的作業,內控風險管理模式(2)財務風險個案11:	
18	101/06/11~ 101/06/17	綜合討論	
修課應 注意事項	1.本課程注意分組討論 2.另有個人風險管理-氣功教學		
教學設備	電腦、投影機		
教材課本	自編教材,講義		
參考書籍	陳錦村:風險管理概要-個案與實務		
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	◆出席率: 30.0 % ◆平時評量: % ◆期中評量: % ◆期末評量: % ◆其他〈分組報告〉: 70.0 %		
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。 ※不法影印是違法的行為。請使用正版教科書，勿不法影印他人著作，以免觸法。		