

淡江大學 101 學年度第 1 學期課程教學計畫表

課程名稱	財務風險控管	授課 教師	路祥琛 CHEUNG-SUM LU
	FINANCIAL RISK MANAGEMENT		
開課系級	財金四 P	開課 資料	選修 單學期 3學分
	TLBXB4P		
系（ 所 ） 教 育 目 標			
配合本校、院教育目標，因應國內外金融情勢的演變，培養財務金融理論與實務兼具的財務金融人才。			
系（ 所 ） 核 心 能 力			
A. 具備財務金融理論與實務的基本知識。 B. 加強相關金融法規的學習。 C. 培養財務金融職場的基本倫理與道德。 D. 提升學生的國際觀與外語能力。 E. 提升學生專業證照之能力。 F. 具備分析國內外金融發展情勢之基本能力。			
課程簡介	介紹財務風險管理的概念及機制，並說明巴塞爾協定的內容。		
	This course provides an overview of the concepts and the mechanics of risk management, including detailed discussions of the Basel Accords.		

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	介紹財務風險管理的基本概念。	Introduce the basic concept of financial risk management.	C2	ABCDEF
2	詳細說明巴塞爾協定的內容。	Detailed discussion of the Basel Accords.	A4	ABCDEF
3	討論常見的風險衡量模型：VaR、Credit Metrics、MKMV、CreditRisk+等。	Present some popular risk measurement models, such as VaR, Credit Metrics, MKMV, and CreditRisk+.	P5	ABCDEF
4	介紹常用的信用衍生性商品。	Discuss some popular credit derivatives.	A3	ABCDEF
5	介紹衡量操作風險的方法。	Introduce the operational risk measurement methods mentioned in the Basel Accord II.	P4	ABCDEF
6	介紹專案融資的基本概念及過程。	Explain the process of project finance.	C4	ABCDEF

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	介紹財務風險管理的基本概念。	講述、討論	紙筆測驗、報告、上課表現
2	詳細說明巴塞爾協定的內容。	講述、討論	紙筆測驗、報告、上課表現
3	討論常見的風險衡量模型：VaR、Credit Metrics、MKMV、CreditRisk+等。	講述、討論	紙筆測驗、上課表現
4	介紹常用的信用衍生性商品。	講述、討論	紙筆測驗、上課表現
5	介紹衡量操作風險的方法。	講述、討論	紙筆測驗、上課表現

6	介紹專案融資的基本概念及過程。	講述、討論	紙筆測驗、上課表現
---	-----------------	-------	-----------

本課程之設計與教學已融入本校校級基本素養

淡江大學校級基本素養	內涵說明
◆ 全球視野	
◆ 洞悉未來	
◇ 資訊運用	
◇ 品德倫理	
◆ 獨立思考	
◇ 樂活健康	
◇ 團隊合作	
◇ 美學涵養	

授 課 進 度 表

週次	日期起訖	內 容 (Subject/Topics)	備 註
1	101/09/10~ 101/09/16	財務風險概論, 9/14	
2	101/09/17~ 101/09/23	巴塞爾資本協定, 9/21	
3	101/09/24~ 101/09/30	巴塞爾資本協定, 9/28	
4	101/10/01~ 101/10/07	市場風險的衡量與管理, 10/5	
5	101/10/08~ 101/10/14	市場風險的衡量與管理, 10/12	
6	101/10/15~ 101/10/21	信用風險的衡量與管理, 10/19	
7	101/10/22~ 101/10/28	信用風險的衡量與管理, 10/26	
8	101/10/29~ 101/11/04	個案與討論, 11/2	第一次課堂討論
9	101/11/05~ 101/11/11	期中考前複習, 11/9	
10	101/11/12~ 101/11/18	期中考試週	
11	101/11/19~ 101/11/25	信用風險的衡量與管理, 11/23	
12	101/11/26~ 101/12/02	信用風險的衡量與管理, 11/30	

13	101/12/03~ 101/12/09	信用風險的衡量與管理, 12/7	
14	101/12/10~ 101/12/16	操作風險的衡量與管理, 12/14	
15	101/12/17~ 101/12/23	專案融資, 12/21	
16	101/12/24~ 101/12/30	個案與討論, 12/28	第二次課堂討論
17	101/12/31~ 102/01/06	期末考前複習, 1/4	
18	102/01/07~ 102/01/13	期末考試週	
修課應 注意事項		制式課程教學計畫表的欄位字數不足, 請修課同學務必到教學支援平台閱讀“修課應注意事項”, 了解自身的責任及權益。	
教學設備		電腦、投影機	
教材課本		財務風險管理, 工具、衡量與未來發展 (二版) - 陳達新與周恆志合著(雙葉書廊)。	
參考書籍		Risk Management - Crouhy, Galai, and Mark (McGraw-Hill). Elements of Financial Risk Management - Christoffersen (Academic Press). The Fundamentals of Risk Measurement - Marrison (McGraw-Hill). 風險管理新標竿, 風險值理論與應用(再版) - 周大慶、沈大白、張大成、敬永康、柯瓊鳳合著(智勝文化)。 風險管理, 風險值(VaR)理論與應用 - 李進生、謝文良、林允永、蔣旨坪、陳達新、盧陽正合著(清蔚科技)。	
批改作業 篇數		2 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: % ◆平時評量: 10.0 % ◆期中評量: 45.0 % ◆期末評量: 40.0 % ◆其他〈課堂討論〉: 5.0 %	
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。	