

淡江大學 101 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	林建志 LIN, CHIEN-CHIN
	RISK MANAGEMENT		
開課系級	財金進學班二A	開課 資料	選修 單學期 3學分
	TLBXE2A		
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			
<p>A. 具備財務金融理論與實務的基本知識。</p> <p>B. 加強相關金融法規的學習。</p> <p>C. 培養財務金融職場的基本倫理與道德。</p> <p>D. 提升學生的國際觀與外語能力。</p> <p>E. 提升學生專業證照之能力。</p> <p>F. 具備分析國內外金融發展情勢之基本能力。</p>			
課程簡介	<p>本課程大致分成四部份：風險管理基礎、市場風險的衡量、信用風險的衡量與管理及財務風險管理的法規環境與未來展望。在風險管理部份我們將討論財務風險的意義。在市場風險的衡量部份，討論現今最重要的市場風險管理與衡量的方法—風險值。在信用風險的衡量與管理方面，會介紹各種信用風險的衡量與管理工具。最後在財務風險管理的法規環境與未來展望這一部份，說明新版巴賽爾資本協定。</p>		
	<p>This class includes four parts: the foundations of risk management, market Risk, credit risk and the regulation and prospection of risk measurement. In the part of the foundations of risk management, we will discuss the the meaning of risk management. In the part of market risk, we introduce the most important measurement for market risk (VaR). In the part of credit risk, we develop the credit risk models. Finally, in the part of the regulation and prospection of risk measurement, Basel I & II are discussed.</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	了解財務風險的分類、意義、限制與目的，以及財務風險管理工具之演變與未來的發展。	To understand the category, the meaning, the restriction and the goal of risk management.	C2	ABCDF
2	學習傳統市場風險衡量的技術及現今最重要的市場風險管理與衡量的方法—風險值	To learn the classical technology for measuring risks, and the most important measurement for market risk—VaR	C3	ABCDEF
3	學習各種信用風險的衡量與管理工具	Study the measurement of credit risk, and develop credit risk models.	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	了解財務風險的分類、意義、限制與目的，以及財務風險管理工具之演變與未來的發展。	講述	紙筆測驗
2	學習傳統市場風險衡量的技術及現今最重要的市場風險管理與衡量的方法—風險值	講述	紙筆測驗
3	學習各種信用風險的衡量與管理工具	講述	紙筆測驗

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	
2	101/09/17~ 101/09/23	財務風險管理的數理基礎	
3	101/09/24~ 101/09/30	財務風險管理的數理基礎	
4	101/10/01~ 101/10/07	貨幣與金融市場交易工具	
5	101/10/08~ 101/10/14	風險管理的工具：衍生性金融商品	
6	101/10/15~ 101/10/21	市場風險衡量：傳統工具 vs.VaR	
7	101/10/22~ 101/10/28	風險值的種類以及計算方法(上)	
8	101/10/29~ 101/11/04	風險值的種類以及計算方法(下)	
9	101/11/05~ 101/11/11	風險值的種類以及計算方法(下)	
10	101/11/12~ 101/11/18	期中考試週	
11	101/11/19~ 101/11/25	信用風險計量模型(一)	
12	101/11/26~ 101/12/02	信用風險計量模型(一)	

13	101/12/03~ 101/12/09	信用風險計量模型(二)	
14	101/12/10~ 101/12/16	信用風險計量模型(二)	
15	101/12/17~ 101/12/23	巴塞爾資本協定之沿革與規定	
16	101/12/24~ 101/12/30	巴塞爾資本協定之沿革與規定	
17	101/12/31~ 102/01/06	新型態風險管理工具	
18	102/01/07~ 102/01/13	期末考試週	
修課應 注意事項			
教學設備		電腦、投影機	
教材課本		財務風險管理二版--雙葉書廊 陳達新、周恆志	
參考書籍			
批改作業 篇數		8 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：30.0 % ◆期中評量：30.0 % ◆期末評量：40.0 % ◆其他〈 〉： %	
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。	