

## 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<br>教師 | 李沃牆<br>LEE, WO-CHIANG |
|   | RISK MANAGEMENT   |          |                       |
| 開課系級  | 財金一博士班 A  | 開課<br>資料 | 選修 單學期 3學分            |
|   | TLBXD1A   |          |                       |
| 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  |   |          |                       |
| <ul style="list-style-type: none"> <li>A. 奠定紮實的財務金融理論基礎。</li> <li>B. 整合跨領域理論與實務的應用能力。</li> <li>C. 熟稔相關財金研究方法與成果。</li> <li>D. 具備獨立研究的學術能力。</li> <li>E. 提升學生的教學能力。</li> <li>F. 提升學術研究國際化之能力。</li> </ul> |   |          |                       |
| 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  | 具備財務風險理論與實務的基本知識       | With financial risk theory and practice knowledge                              | C2   | BCD      |
| 2  | 增進風險管理的知識              | Advanced knowledge in risk management.   | C3   | 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. | P4   | BC       |

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  | 具備財務風險理論與實務的基本知識       | 講述、討論 | 報告    |
| 2  | 增進風險管理的知識              | 講述    | 實作、報告 |
| 3  | 增進對市場風險,信用風險,作業風險的分析能力 | 講述、討論 | 實作、報告 |
|    |                        |       |       |

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~<br>101/09/16 | Introduction(Chapters 1) What is risk? Risk management?   |    |
| 2  | 101/09/17~<br>101/09/23 | Financial Products and how they are used for hedging,Portfolio analysis (Chapters 2) (Exercise 1) |    |
| 3  | 101/09/24~<br>101/09/30 | How traders manage their exposures  |    |
| 4  | 101/10/01~<br>101/10/07 | Market Risk-Volatility (Chapter 5) (Exercise 3)   |    |
| 5  | 101/10/08~<br>101/10/14 | Bank Regulation and Basel II (Chapter 7)  |    |
| 6  | 101/10/15~<br>101/10/21 | Market Risk-VaR Model((Chapter 8)   |    |
| 7  | 101/10/22~<br>101/10/28 | Market Risk-VaR Model-(Chapter 9)-(Exercise 4)  |    |
| 8  | 101/10/29~<br>101/11/04 | 1 Market Risk-VaR Model-.Extreme value theory(Ch9)  |    |
| 9  | 101/11/05~<br>101/11/11 | Credit Risk: Estimating Default Probabilities   |    |
| 10 | 101/11/12~<br>101/11/18 | 期中考試週(Midterm)  |    |
| 11 | 101/11/19~<br>101/11/25 | Credit Risk: Estimating Default Probabilities   |    |
| 12 | 101/11/26~<br>101/12/02 | Credit Risk: Estimating Default Probabilities   |    |

|              |                         |   |  |
|--------------|-------------------------|---|--|
| 13           | 101/12/03~<br>101/12/09 | Credit Derivatives (Chapter 13)   |  |
| 14           | 101/12/10~<br>101/12/16 | Correlation and Copula(Chapter 6-2)   |  |
| 15           | 101/12/17~<br>101/12/23 | Operational Risk (Chapter 14)-1   |  |
| 16           | 101/12/24~<br>101/12/30 | Operational Risk (Chapter 14)-2   |  |
| 17           | 101/12/31~<br>102/01/06 | Data Mining in Credit Risk-Introduction   |  |
| 18           | 102/01/07~<br>102/01/13 | 期末考試週(Final Exam)   |  |
| 修課應<br>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)<br>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<br>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<br>計算方式 |                         | ◆出席率： 20.0 %   ◆平時評量：       %   ◆期中評量：       %<br>◆期末評量：40.0 %<br>◆其他〈報告, term paper〉：40.0 %  |  |
| 備 考          |                         | 「教學計畫表管理系統」網址： <a href="http://info.ais.tku.edu.tw/csp">http://info.ais.tku.edu.tw/csp</a> 或由教務處<br>首頁〈網址： <a href="http://www.acad.tku.edu.tw/index.asp/">http://www.acad.tku.edu.tw/index.asp/</a> 〉教務資訊「教學計畫<br>表管理系統」進入。<br><b>※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。</b> |  |