

淡江大學 101 學年度第 2 學期課程教學計畫表

課程名稱	財務風險管理	授課 教師	謝宗佑 TSUNG-YU HSIEH
	MANAGEMENT OF FINANCIAL RISK		
開課系級	財金一碩士班 A	開課 資料	必修 單學期 3學分
	TLBXM1A		
系（所）教育目標			
以完整進階的財務金融課程，培養具獨立分析、判斷與解決問題的財務專業人才。			
系（所）核心能力			
<p>A. 培養進階財務金融理論的知識。</p> <p>B. 提升應用理論與實務技巧。</p> <p>C. 加強邏輯推演的能力。</p> <p>D. 財金研究方法的學習與運用。</p> <p>E. 提升考取高階財金專業證照之能力。</p> <p>F. 具備學術未來深造的潛力。</p>			
課程簡介	<p>本課程主要在介紹財務風險之範疇、衡量與管理工具。課程內容包含：風險值VaR的介紹、衡量模型與應用；利率風險的衡量與管理；信用風險的衡量與管理；以及巴賽爾資本協定的相關規定。</p>		
	<p>This course introduces the theory and applications of financial risk management. The following topics will be provided: (1)introduction, measurement models and applications of value at risk (VaR); (2) measurement and management of interest rate risk; (3) measurement and management of credit risk; (4) introduction of Basel Capital Accord, and case studies.</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	認識財務風險管理的意義與架構	To understand the meaning and framework of financial risk management	C5	AD
2	認識風險值的衡量與管理, 學習利率風險與信用風險的衡量模型與管理	To understand the measurement and management of VaR. To learn the measurement models and management of the risk of interest rate and credit.	C5	AD
3	知曉巴塞爾資本協定的意義	To learn the meaning of Basel Capital Accord.	C5	AD

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	認識財務風險管理的意義與架構	講述、討論、實作、問題解決	紙筆測驗、實作、報告、上課表現
2	認識風險值的衡量與管理, 學習利率風險與信用風險的衡量模型與管理	講述、討論、實作、問題解決	紙筆測驗、實作、報告、上課表現
3	知曉巴塞爾資本協定的意義	講述、討論、實作、問題解決	紙筆測驗、實作、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

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	102/02/18~ 102/02/24	財務風險介紹與概論	
2	102/02/25~ 102/03/03	金融市場交易工具	
3	102/03/04~ 102/03/10	財務風險管理架構	
4	102/03/11~ 102/03/17	風險管理的工具	
5	102/03/18~ 102/03/24	市場風險之衡量：VaR與市場風險	
6	102/03/25~ 102/03/31	衡量風險值VaR的方法(一)	
7	102/04/01~ 102/04/07	衡量風險值VaR的方法(二)	
8	102/04/08~ 102/04/14	模型的應用與測試(一)	
9	102/04/15~ 102/04/21	模型的應用與測試(二)	
10	102/04/22~ 102/04/28	期中考試週	
11	102/04/29~ 102/05/05	利率風險與資產負債管理	
12	102/05/06~ 102/05/12	利率理論與應用	

13	102/05/13~ 102/05/19	信用風險與衡量	
14	102/05/20~ 102/05/26	信用風險衡量模型(一)	
15	102/05/27~ 102/06/02	信用風險衡量模型(二)	
16	102/06/03~ 102/06/09	巴塞爾資本協定	
17	102/06/10~ 102/06/16	風險管理的趨勢與新工具	
18	102/06/17~ 102/06/23	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	Hull, J. C., Risk Management and Financial Institution		
參考書籍	財務風險管理-工具、衡量與未來發展 (二版), 陳達新、周恆志。 信用連結商品個案之分析與評價, 陳松男。		
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：            %   ◆平時評量：20.0 %   ◆期中評量：40.0 % ◆期末評量：        % ◆其他〈期末報告〉：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 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 表管理系統」進入。 <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>		