

淡江大學 101 學年度第 2 學期課程教學計畫表

課程名稱	風險管理	授課 教師	莊忠柱 CHUNG-CHU CHUANG
	RISK MANAGEMENT		
開課系級	管科一碩士班 A	開課 資料	選修 單學期 3學分
	TLGXM1A		
系（所）教育目標			
培育具備良好數理分析與邏輯判斷能力之中階管理人才，以因應國內外企業之需要。			
系（所）核心能力			
<p>A. 培育具有決策分析課程學習之能力。</p> <p>B. 培育具有企業經營課程學習之能力。</p> <p>C. 培育具有統計分析課程學習之能力。</p> <p>D. 培育具有財經分析課程學習之能力。</p> <p>E. 培育具有科際整合之能力。</p> <p>F. 培育具有企業實務之能力。</p> <p>G. 具有外語運用能力。</p> <p>H. 具有學術論文競賽能力。</p>			
課程簡介	學習瞭解如何辨識、衡量與掌控投資風險的一種管理過程，特別是金融風險與營業風險。		
	To learn the management process of how to understand, identify, measure and control the risk of the investments, especially for business risk and financial 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	瞭解所有市場特性(如固定收益、外匯、權益、衍生性商品與商品市場等)、交易制度的複雜性與統計風險模型。	Understand the characters of markets (e.g., fixed income, exchange rate, equity, derivatives and commodity markets), complexity of trade system, statistical risk models.	C2	ABCDF
2	依據風險管理目的，瞭解如何整合市場攸關資訊(包含固定收益、外匯、權益、衍生性金融商品與商品市場等)來管理風險。	Understand how the all relevant market information (e.g., fixed income, exchange rate, equity, derivatives and commodity markets) is integrated to manage he risk, which depends on the goals of risk management.	P4	ABCDF

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	瞭解所有市場特性(如固定收益、外匯、權益、衍生性商品與商品市場等)、交易制度的複雜性與統計風險模型。	講述、討論、模擬	報告、上課表現
2	依據風險管理目的，瞭解如何整合市場攸關資訊(包含固定收益、外匯、權益、衍生性金融商品與商品市場等)來管理風險。	講述、討論、模擬	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	導論 基礎機率與統計概念	
2	102/02/25~ 102/03/03	現值與利率關係	
3	102/03/04~ 102/03/10	衍生性金融商品	
4	102/03/11~ 102/03/17	選擇權市場	
5	102/03/18~ 102/03/24	固定收益證券	
6	102/03/25~ 102/03/31	固定收益型之衍生性金融商品	
7	102/04/01~ 102/04/07	權益證券市場	
8	102/04/08~ 102/04/14	外匯與商品市場	
9	102/04/15~ 102/04/21	避險	
10	102/04/22~ 102/04/28	衡量市場風險的方法	
11	102/04/29~ 102/05/05	專題演講	
12	102/05/06~ 102/05/12	衡量違約風險 精算法	

13	102/05/13~ 102/05/19	衡量違約風險 市場價值法	
14	102/05/20~ 102/05/26	信用暴險額	
15	102/05/27~ 102/06/02	信用衍生性商品	
16	102/06/03~ 102/06/09	作業風險	
17	102/06/10~ 102/06/16	風險報導的最佳實務	
18	102/06/17~ 102/06/23	風險報導的最佳實務	
修課應 注意事項			
教學設備		電腦、投影機	
教材課本		台灣金融研訓院編輯委員會(2006), 「風險管理理論與方法」, 台北:台灣金融研訓院。	
參考書籍		黃達業和張榕榕譯, Phillip Jorian著(2005), 「風險值-金融風險管理的新基準」, 台北:台灣金融研訓院。	
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: 20.0 % ◆期中評量: % ◆期末評量: % ◆其他〈報告〉: 50.0 %	
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。	