

淡江大學 102 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			
<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	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	AF
2	詳細說明巴塞爾協定的內容。	Discuss the Basel Accords in detail.	A4	AF
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	A
4	介紹常用的信用衍生性商品。	Discuss some popular credit derivatives.	A3	A
5	介紹衡量操作風險的方法。	Introduce the operational risk measurement methods mentioned in the Basel Accords.	P4	A
6	介紹專案融資的基本概念及過程。	Explain the process of project finance.	C4	A

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、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、實作	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、實作	紙筆測驗、上課表現
5	介紹衡量操作風險的方法。	講述、討論、實作	紙筆測驗、報告、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	培養認識國際社會變遷的能力，以更寬廣的視野了解全球化的發展。
◆ 資訊運用	熟悉資訊科技的發展與使用，並能收集、分析和妥適運用資訊。
◇ 洞悉未來	瞭解自我發展、社會脈動和科技發展，以期具備建構未來願景的能力。
◇ 品德倫理	了解為人處事之道，實踐同理心和關懷萬物，反省道德原則的建構並解決道德爭議的難題。
◆ 獨立思考	鼓勵主動觀察和發掘問題，並培養邏輯推理與批判的思考能力。
◇ 樂活健康	注重身心靈和環境的和諧，建立正向健康的生活型態。
◇ 團隊合作	體察人我差異和增進溝通方法，培養資源整合與互相合作共同學習解決問題的能力。
◇ 美學涵養	培養對美的事物之易感性，提升美學鑑賞、表達及創作能力。

授課進度表

週次	日期起訖	內容 (Subject/Topics)	備註
1	102/09/16~ 102/09/22	調整放假, 9/20	放假一天
2	102/09/23~ 102/09/29	財務風險概論, 9/27	
3	102/09/30~ 102/10/06	巴塞爾資本協定, 10/4	
4	102/10/07~ 102/10/13	巴塞爾資本協定, 10/11	
5	102/10/14~ 102/10/20	市場風險的衡量與管理, 10/18	
6	102/10/21~ 102/10/27	市場風險的衡量與管理, 10/25	
7	102/10/28~ 102/11/03	信用風險的衡量與管理, 11/1	
8	102/11/04~ 102/11/10	個案與討論, 11/8	第一次課堂討論
9	102/11/11~ 102/11/17	期中考前複習, 11/15	
10	102/11/18~ 102/11/24	期中考試週	
11	102/11/25~ 102/12/01	信用風險的衡量與管理, 11/29	
12	102/12/02~ 102/12/08	信用風險的衡量與管理, 12/6	

13	102/12/09~ 102/12/15	信用風險的衡量與管理, 12/13	
14	102/12/16~ 102/12/22	操作風險的衡量與管理, 12/20	
15	102/12/23~ 102/12/29	專案融資, 12/27	
16	102/12/30~ 103/01/05	個案與討論, 1/3	第二次課堂討論
17	103/01/06~ 103/01/12	期末考前複習, 1/10	
18	103/01/13~ 103/01/19	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: 5.0 % ◆平時評量: 15.0 % ◆期中評量: 40.0 % ◆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/CS/main.php 〉業務連結「教師教學計畫表上傳下載」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。		