

淡江大學 102 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 | 莊忠柱 CHUNG-CHU CHUANG |
| | MANAGEMENT OF FINANCIAL RISK | | |
| 開課系級 | 管科系三A | 開課 資料 | 選修 單學期 3學分 |
| | TLGXB3A | | |
| 系 (所) 教育目標 | | | |
| <p>一、精實管理科學專業。</p> <p>二、學習自我成長。</p> <p>三、連結理論與實務。</p> <p>四、增進團隊合作溝通。</p> <p>五、培養判斷與分析技巧。</p> <p>六、重視組織永續經營。</p> | | | |
| 系 (所) 核心能力 | | | |
| <p>A. 決策分析能力。</p> <p>B. 統計分析能力。</p> <p>C. 財經分析能力。</p> <p>D. 組織經營管理能力。</p> <p>E. 團隊合作能力。</p> <p>F. 自我管理能力。</p> <p>G. 道德倫理能力。</p> | | | |
| 課程簡介 | <p>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。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。</p> | | |
| | <p>Understand the characters of markets (e.g., fixed income, exchange rate, equity, derivatives and commodity markets), complexity of trade system, statistical risk models.</p> <p>Understand how the all relevant market information (e.g., fixed income, exchange rate, equity, derivatives and commodity markets) is integrated to manage the risk, which depends on the goals of risk management.</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 | 學習瞭解如何辨識、衡量、掌控與監督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 identify, measure, control and supervise the risk of the investments, especially for business risk and financial risk. | P4 | ABCEFG |

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 | 學習瞭解如何辨識、衡量、掌控與監督投資風險的一種管理過程，特別是金融風險與營業風險。 | 講述、討論、問題解決 | 紙筆測驗、上課表現、分組報告 |
| | | | |

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 | 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 | 103/02/17~ 103/02/23 | 基礎機率與統計概念 | |
| 2 | 103/02/24~ 103/03/02 | 現值與利率關係 | |
| 3 | 103/03/03~ 103/03/09 | 衍生性金融商品 | |
| 4 | 103/03/10~ 103/03/16 | 選擇權市場 | |
| 5 | 103/03/17~ 103/03/23 | 固定收益證券 | |
| 6 | 103/03/24~ 103/03/30 | 固定收益型之衍生性金融商品 | |
| 7 | 103/03/31~ 103/04/06 | 權益證券市場 | |
| 8 | 103/04/07~ 103/04/13 | 外匯與商品市場 | |
| 9 | 103/04/14~ 103/04/20 | 避險 | |
| 10 | 103/04/21~ 103/04/27 | 期中考試週 | |
| 11 | 103/04/28~ 103/05/04 | 市場風險 | |
| 12 | 103/05/05~ 103/05/11 | 信用風險 | |

| | | | |
|--------------|-------------------------|---|--|
| 13 | 103/05/12~ 103/05/18 | 衡量違約風險 | |
| 14 | 103/05/19~ 103/05/25 | 衡量違約風險 | |
| 15 | 103/05/26~ 103/06/01 | 信用暴險額 | |
| 16 | 103/06/02~ 103/06/08 | 信用衍生性商品 | |
| 17 | 103/06/09~ 103/06/15 | 信用衍生性商品 | |
| 18 | 103/06/16~ 103/06/22 | 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 | | 陳達欣翰周恆志(2010), 「財務風險管理」, 台北：雙葉書廊。 | |
| 參考書籍 | | 汪逸真、絲文銘和鄭昌鏞(2011), 「財務風險管理」, 台北：新陸書局股份有限公司 | |
| 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： % ◆期中評量：30.0 % ◆期末評量：30.0 % ◆其他〈分組報告〉：10.0 % | |
| 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/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。 | |