

淡江大學 104 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	王譯賢
	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>本課程旨在教授有關財務風險管理領域的進階內容與相關分析方法。首先，介紹財務風險管理之管理要素；再提供相關衡量財務風險之方法與應用，以及風險性投資及避險策略運用分析等之重要的風險管理議題。</p>		
	<p>The purpose of this course is trying to offer the brief review of concepts of probability, statistical analysis, and financial risk management for students. First, we introduce the advance concepts of financial risk management, and provide the quick access to measurement and applications of financial risk.</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	學生將能在瞭解財務風險管理與投資規劃相關領域直接相關的議題，實際搜集資料並進行分析、解讀與應用。	Students will be able to discover course that related knowledge and information about financial risk management and investment, to get analyzing results. They are also required to interpret or explain the empirical evidence.	A5	ABCD
2	學生將能夠對於較深入的學理及進行演練，以致於能增進未來更深入議題的扎實基礎。	Students will be able to learn in order to get firm foundation in depth with advanced topics in future leaning career.	C3	ABC

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	學生將能在瞭解財務風險管理與投資規劃相關領域直接相關的議題，實際搜集資料並進行分析、解讀與應用。	講述、討論	紙筆測驗、實作、報告
2	學生將能夠對於較深入的學理及進行演練，以致於能增進未來更深入議題的扎實基礎。	講述、討論、實作	紙筆測驗、實作

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	105/02/15~ 105/02/21	財務風險概論之課程簡介	財務風險管理的來源與意義
2	105/02/22~ 105/02/28	財務風險概論	財務風險的種類
3	105/02/29~ 105/03/06	財務風險管理的數理基礎	財務風險管理工具的演變與未來發展
4	105/03/07~ 105/03/13	貨幣與金融市場交易工具	權益型證券、固定收益證券、外匯、商品市場
5	105/03/14~ 105/03/20	風險管理的工具：衍生性金融商品	遠期契約、期貨與選擇權
6	105/03/21~ 105/03/27	傳統的風險衡量指標與工具	風險衡量指標
7	105/03/28~ 105/04/03	市場風險衡量：傳統方法 vs. VaR	計算的重要參數
8	105/04/04~ 105/04/10	風險值的種類以及計算方法(上)	變異數 - 共變異數法
9	105/04/11~ 105/04/17	風險值的種類以及計算方法(下)	歷史模擬法、蒙地卡羅模擬法、回溯測試、壓力測試
10	105/04/18~ 105/04/24	期中考試週	
11	105/04/25~ 105/05/01	信用風險的起因與傳統衡量工具	信用風險衡量技術

12	105/05/02~ 105/05/08	信用風險計量模型(一)	信用矩陣與風險矩陣的關係
13	105/05/09~ 105/05/15	信用風險計量模型(二)	信用風險模型比較與未來發展趨勢
14	105/05/16~ 105/05/22	巴塞爾資本協定之沿革與規定 (I)	巴塞爾資本協定之沿革
15	105/05/23~ 105/05/29	巴塞爾資本協定之沿革與規定 (II)	新舊版資本協定之比較
16	105/05/30~ 105/06/05	全方位風險管理	風險調整資本報酬率
17	105/06/06~ 105/06/12	新型態風險管理工具	衍生性商品
18	105/06/13~ 105/06/19	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	陳達新、周恆志。財務風險管理 (三版) : 工具、衡量與未來發展, 雙葉書廊。		
參考書籍	Allen, S. L. (2012). Financial Risk Management: A Practitioner's Guide to Managing Market and Credit Risk (Vol. 721). John Wiley & Sons.		
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: 20.0 % ◆平時評量: 25.0 % ◆期中評量: 25.0 % ◆期末評量: 30.0 % ◆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。		