

淡江大學 105 學年度第 2 學期課程教學計畫表

課程名稱	財務風險個案	授課 教師	李沃牆 LEE, WO-CHIANG
	FINANCIAL RISK-CASE STUDY		
開課系級	財金二碩專班 A	開課 資料	選修 單學期 3學分
	TLBXJ2A		
系（所）教育目標			
提供財務金融產業人才之專業訓練課程，以落實實務與理論融合應用之能力。			
系（所）核心能力			
<p>A. 具備理論與實務融合應用之能力。</p> <p>B. 具備個案研究與分析的能力。</p> <p>C. 培養具備企業財務決策與分析之能力。</p> <p>D. 發展專業競爭的能力與態度。</p> <p>E. 提升財金研究理論與方法之素養。</p> <p>F. 提升考取高階財金專業證照之能力。</p>			
課程簡介	<p>本課程由風險管理的觀念著手，分別介紹市場風險、信用風險及作業風險的理論與模型、再透過國內外近幾年較為有名的財務風險個案進行分組討論，可讓學生瞭解風險的重要性及避險的必要性。</p>		
	<p>The course first introduce the basic risk concepts, include the market risk ,credit risk and operation risk theory and models. We also to discuss the famous financial crisis cases. Students will understand the importance of risk and the necessity of hedging.</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	具備財務風險管理觀念	With financial risk knowledge	C2	ABC
2	具備財務風險分析能力	With the analytic capability of financial risk	C4	BCE
3	提升財務風險管理能力	Enhanced the management capability of financial risk	C4	BCE

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	具備財務風險管理觀念	講述、討論	報告、上課表現
2	具備財務風險分析能力	講述、討論	報告、上課表現
3	提升財務風險管理能力	講述、討論	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	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	106/02/13~ 106/02/19	課程介紹	
2	106/02/20~ 106/02/26	風險管理概述、分組報告說明	
3	106/02/27~ 106/03/05	新版巴塞爾協定與金融風險管理	
4	106/03/06~ 106/03/12	市場風險概述與風險值定義;投信的市場風險管理模式	
5	106/03/13~ 106/03/19	風險值模型與實作(1)	
6	106/03/20~ 106/03/26	風險值模型與實作(2)	
7	106/03/27~ 106/04/02	(1)風險值模型與實作(3)財務風險個案1:	
8	106/04/03~ 106/04/09	(1)利率風險與資產負債管理(1)(2)財務風險個案2:	
9	106/04/10~ 106/04/16	(1)利率風險與資產負債管理(2)(2)財務風險個案3:	
10	106/04/17~ 106/04/23	期中考	
11	106/04/24~ 106/04/30	(1)信用風險與違約機率;投信的信用風險管理模式(2)財務風險個案4:	
12	106/05/01~ 106/05/07	(1)信用風險模型與實作(1) (2)財務風險個案6:	

13	106/05/08~ 106/05/14	(1)信用風險模型與實作(2) (2)財務風險個案7:	
14	106/05/15~ 106/05/21	(1)資產組合之信用風險評估與實作(2)財務風險個案8:	
15	106/05/22~ 106/05/28	(1)作業風險與評估;投信的作業,內控風險管理模式(2)財務風險個案9:	
16	106/05/29~ 106/06/04	(1)作業風險與評估;投信的作業,內控風險管理模式(2)財務風險個案10:	
17	106/06/05~ 106/06/11	(1)作業風險與評估;投信的作業,內控風險管理模式(2)財務風險個案11:	
18	106/06/12~ 106/06/18	綜合討論	
修課應 注意事項	1.本課程注意分組討論 2.另有個人風險管理-氣功教學		
教學設備	電腦、投影機		
教材課本	自編教材,講義		
參考書籍	陳錦村:風險管理概要-個案與實務		
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:       % ◆期末評量:       % ◆其他〈分組報告〉: 70.0 %		
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/CS/main.php">http://www.acad.tku.edu.tw/CS/main.php</a> 〉業務連結「教師教學 計畫表上傳下載」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>		