

淡江大學 106 學年度第 1 學期課程教學計畫表

課程名稱	風險管理	授課 教師	李沃牆 LEE, WO-CHIANG
	RISK MANAGEMENT		
開課系級	財金一博士班 A	開課 資料	選修 單學期 3學分
	TLBXD1A		
系（所）教育目標			
紮實的財務理論基礎與嚴謹的研究方法，培養具國際視野與獨立研究能力之學術人才。			
系（所）核心能力			
<p>A. 奠定紮實的財務金融理論基礎。</p> <p>B. 整合跨領域理論與實務的應用能力。</p> <p>C. 熟稔相關財金研究方法與成果。</p> <p>D. 具備獨立研究的學術能力。</p> <p>E. 提升學生的教學能力。</p> <p>F. 提升學術研究國際化之能力。</p>			
課程簡介	讓修課學生能夠瞭解風險管理基本觀念,進而探討市場風險,信用風險,與作業風險		
	Let the students can understand the concept of risk management, further to discuss the market risk, credit risk and operational 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	具備財務風險理論與實務的基本知識	With financial risk theory and practice knowledge	C2	ABD
2	增進風險管理的知識	Advanced knowledge in risk management.	C2	ADE
3	增進對市場風險,信用風險,作業風險的分析能力	Enhanced analytic capability in market risk, credit risk and operational risk.	P4	CDF

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	具備財務風險理論與實務的基本知識	講述、討論	報告
2	增進風險管理的知識	講述	實作、報告
3	增進對市場風險,信用風險,作業風險的分析能力	講述、討論	實作、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	106/09/18~ 106/09/24	Introduction What is risk? Risk management?	
2	106/09/25~ 106/10/01	Financial Products and how they are used for hedging,Portfolio analysis & Matlab (Exercise 1)	
3	106/10/02~ 106/10/08	How traders manage their exposures	
4	106/10/09~ 106/10/15	Market Risk-Volatility(Exercise 3)	
5	106/10/16~ 106/10/22	Bank Regulation and Basel II	
6	106/10/23~ 106/10/29	Market Risk-VaR Model	
7	106/10/30~ 106/11/05	Market Risk-VaR Model(Exercise 4)	
8	106/11/06~ 106/11/12	1 Market Risk-VaR Model-.Extreme value theory	
9	106/11/13~ 106/11/19	Credit Risk: Estimating Default Probabilities	
10	106/11/20~ 106/11/26	期中考試週(Midterm)	
11	106/11/27~ 106/12/03	Credit Risk: Estimating Default Probabilities	
12	106/12/04~ 106/12/10	Credit Risk: Estimating Default Probabilities	

13	106/12/11~ 106/12/17	Credit Derivatives	
14	106/12/18~ 106/12/24	Correlation and Copula	
15	106/12/25~ 106/12/31	Operational Risk-1	
16	107/01/01~ 107/01/07	Operational Risk -2	
17	107/01/08~ 107/01/14	Data Mining in Credit Risk-Introduction	
18	107/01/15~ 107/01/21	期末考試週(Final Exam)	
修課應 注意事項			
教學設備		電腦	
教材課本		1. John Hull(2010), Risk Management and Financial Institutions , 2nd, Pearson Prentice Hall(雙葉書局代理) 2 Lee,Wo-Chiang(2017),Lecture Note	
參考書籍		3 Philippe Jorion(2007),Value at Risk,3nd,Mcgraw Hill (新月代理)	
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： % ◆期中評量： % ◆期末評量：40.0 % ◆其他〈報告, term paper〉：40.0 %	
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。	