

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 | 商管金融博一 R | 開課 資料 | 選修 單學期 3學分 |
| | TLXED1R | | |
| 系（所）教育目標 | | | |
| 培育現代化跨領域的金融產業經營管理之專業人才。 | | | |
| 系（所）核心能力 | | | |
| <p>A. 奠定紮實的金融產業與經營管理的理論基礎。</p> <p>B. 具備整合跨領域理論與實務的應用能力。</p> <p>C. 具備獨立研究與分析與產業經營實作能力。</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 | AB |
| 2 | 增進風險管理的知識 | Advanced knowledge in risk management. | C2 | AC |
| 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 | BC |

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。 | |