

淡江大學 108 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 YI-HSIEN WANG
	MANAGEMENT OF FINANCIAL RISK		
開課系級	管科系三 P	開課 資料	實體課程 選修 單學期 3學分
	TLGXB3P		
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>			
本課程對應院、系(所)核心能力之項目與比重			
<p>A. 事業經營管理能力。(比重：30.00)</p> <p>C. 統計與決策分析能力。(比重：30.00)</p> <p>D. 財經分析能力。(比重：40.00)</p>			
本課程對應校級基本素養之項目與比重			
<p>2. 資訊運用。(比重：20.00)</p> <p>4. 品德倫理。(比重：30.00)</p> <p>5. 獨立思考。(比重：50.00)</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>		

本課程教學目標與認知、情意、技能目標之對應

將課程教學目標分別對應「認知 (Cognitive)」、「情意 (Affective)」與「技能(Psychomotor)」的各目標類型。

- 一、認知(Cognitive)：著重在該科目的事實、概念、程序、後設認知等各類知識之學習。
- 二、情意(Affective)：著重在該科目的興趣、倫理、態度、信念、價值觀等之學習。
- 三、技能(Psychomotor)：著重在該科目的肢體動作或技術操作之學習。

序號	教學目標(中文)	教學目標(英文)
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.
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.

教學目標之目標類型、核心能力、基本素養教學方法與評量方式

序號	目標類型	院、系(所)核心能力	校級基本素養	教學方法	評量方式
1	情意	ACD	245	講述、討論	測驗、作業、討論(含課堂、線上)
2	認知	ACD	245	講述、討論、實作	測驗、實作

授課進度表

週次	日期起訖	內容 (Subject/Topics)	備註
1	109/03/02~ 109/03/08	財務風險概論之課程簡介	財務風險管理的來源與意義
2	109/03/09~ 109/03/15	財務風險概論	財務風險的種類
3	109/03/16~ 109/03/22	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	109/03/23~ 109/03/29	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	109/03/30~ 109/04/05	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	109/04/06~ 109/04/12	傳統的風險衡量指標與工具	風險衡量指標
7	109/04/13~ 109/04/19	市場風險衡量：傳統方法 vs. VaR	計算的重要參數
8	109/04/20~ 109/04/26	風險值的種類以及計算方法(上)	變異數 - 共變異數法
9	109/04/27~ 109/05/03	期中考試週	
10	109/05/04~ 109/05/10	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

11	109/05/11~ 109/05/17	信用風險的起因與傳統衡量工具	信用風險衡量技術
12	109/05/18~ 109/05/24	信用風險計量模型(一)	信用矩陣與風險矩陣的關係
13	109/05/25~ 109/05/31	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	109/06/01~ 109/06/07	巴賽爾資本協定之沿革與規定 (I)	巴賽爾資本協定之沿革
15	109/06/08~ 109/06/14	巴賽爾資本協定之沿革與規定 (II)	新舊版資本協定之比較
16	109/06/15~ 109/06/21	全方位風險管理	風險調整資本報酬率
17	109/06/22~ 109/06/28	期末考試週(本學期期末考試日期 為:109/6/18-109/6/24)	
18	109/06/29~ 109/07/05	教師彈性補充教學： 新型態風險管理工具	衍生性商品
修課應 注意事項			
教學設備	電腦、投影機		
教科書與 教材	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。		
參考文獻	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： https://info.ais.tku.edu.tw/csp 或由教務處 首頁→教務資訊「教學計畫表管理系統」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。		