

淡江大學 109 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	實體課程 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。			
本課程對應院、系(所)核心能力之項目與比重			
A. 奠定紮實的財務金融理論基礎。(比重：80.00) D. 具備獨立研究的學術能力。(比重：20.00)			
本課程對應校級基本素養之項目與比重			
2. 資訊運用。(比重：30.00) 4. 品德倫理。(比重：20.00) 5. 獨立思考。(比重：50.00)			
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	具備財務風險理論與實務的基本知識	With financial risk theory and practice knowledge	

2	增進風險管理的知識			Advanced knowledge in risk management.	
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.	
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	認知	AD	245	講述、討論	作業、討論(含課堂、線上)、報告(含口頭、書面)
2	認知	AD	245	講述、討論	作業、討論(含課堂、線上)、報告(含口頭、書面)
3	技能	AD	245	講述、討論	作業、實作、報告(含口頭、書面)
授 課 進 度 表					
週次	日期起訖	內 容 (Subject/Topics)			備註
1	109/09/14~109/09/20	Introduction What is risk? Risk management?			
2	109/09/21~109/09/27	Financial Products and how they are used for hedging,Portfolio analysis & Matlab (Exercise 1)			
3	109/09/28~109/10/04	How traders manage their exposures			
4	109/10/05~109/10/11	Market Risk-Volatility(Exercise 3)			
5	109/10/12~109/10/18	Bank Regulation and Basel II			
6	109/10/19~109/10/25	Market Risk-VaR Model			
7	109/10/26~109/11/01	Market Risk-VaR Model(Exercise 4)			
8	109/11/02~109/11/08	1 Market Risk-VaR Model-.Extreme value theory			
9	109/11/09~109/11/15	Credit Risk: Estimating Default Probabilities			
10	109/11/16~109/11/22	期中考試週(Midterm)			
11	109/11/23~109/11/29	Credit Risk: Estimating Default Probabilities			
12	109/11/30~109/12/06	Credit Risk: Estimating Default Probabilities			
13	109/12/07~109/12/13	Credit Derivatives			
14	109/12/14~109/12/20	課程調整至守謙國際會議中心			
15	109/12/21~109/12/27	Operational Risk-1			

16	109/12/28~ 110/01/03	Operational Risk -2	
17	110/01/04~ 110/01/10	Data Mining in Credit Risk-Introduction	
18	110/01/11~ 110/01/17	期末考試週(Final Exam)	
修課應 注意事項	no		
教學設備	電腦		
教科書與 教材	1. John Hull(2010), Risk Management and Financial Institutions , 2nd, Pearson Prentice Hall(雙葉書局代理) 2 Lee,Wo-Chiang(2020),Lecture Note		
參考文獻	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： 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。		