

淡江大學 1 1 1 學年度第 2 學期課程教學計畫表

|  |   |          |                                    |
|--|---|----------|------------------------------------|
| 課程名稱   | 風險管理  | 授課<br>教師 | (多位教師合開)<br>林建志<br>LIN, CHIEN-CHIN |
|  | RISK MANAGEMENT   |          |                                    |
| 開課系級   | 財金四 P   | 開課<br>資料 | 實體課程<br>選修 單學期 3學分                 |
|  | TLBXB4P   |          |                                    |
| 課程與SDGs<br>關聯性   | SDG4 優質教育   |          |                                    |
| 系 ( 所 ) 教育目標   |   |          |                                    |
| 配合本校、院教育目標，因應國內外金融情勢的演變，培養財務金融理論與實務兼具的財務金融人才。  |   |          |                                    |
| 本課程對應院、系(所)核心能力之項目與比重  |   |          |                                    |
| <p>A. 具備財務金融理論與實務的基本知識。(比重：35.00)</p> <p>B. 加強相關金融法規的學習。(比重：20.00)</p> <p>C. 培養財務金融職場的基本倫理與道德。(比重：10.00)</p> <p>D. 提升學生的國際觀與外語能力。(比重：10.00)</p> <p>E. 提升學生專業證照之能力。(比重：10.00)</p> <p>F. 具備分析國內外金融發展情勢之基本能力。(比重：15.00)</p> |   |          |                                    |
| 本課程對應校級基本素養之項目與比重  |   |          |                                    |
| <p>1. 全球視野。(比重：5.00)</p> <p>2. 資訊運用。(比重：20.00)</p> <p>3. 洞悉未來。(比重：5.00)</p> <p>4. 品德倫理。(比重：20.00)</p> <p>5. 獨立思考。(比重：30.00)</p> <p>6. 樂活健康。(比重：5.00)</p> <p>7. 團隊合作。(比重：10.00)</p> <p>8. 美學涵養。(比重：5.00)</p>              |   |          |                                    |
| 課程簡介   | 金融風險管理日益受到重視，本課程主要是介紹風險管理的意義、衡量工具及未來的發展，使同學具備風險管理基本知識及如何衡量金融風險。 |          |                                    |

|  |  |
|--|--|
|  | The main object of this course is to introduce the basic concept of financial risk management, the tool to measure the financial risk, and the future of financial management. |
|--|--|

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  | 瞭解金融風險管理概念，進入職場準備。 | Understanding the basic concept of financial risk management to be ready to enter the carrier of financial institutions. |

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   | ABCDEF     | 12345678 | 講述、實作 | 測驗、作業、討論(含課堂、線上)、實作 |

授課進度表

| 週次 | 日期起訖                    | 內容 (Subject/Topics)                                 | 備註 |
|----|-------------------------|---|----|
| 1  | 112/02/13~<br>112/02/19 | 課程簡介及概論   |    |
| 2  | 112/02/20~<br>112/02/26 | Insurance companies                                 |    |
| 3  | 112/02/27~<br>112/03/05 | Pension plans                                       |    |
| 4  | 112/03/06~<br>112/03/12 | Volatility estimation                               |    |
| 5  | 112/03/13~<br>112/03/19 | GARCH Model   |    |
| 6  | 112/03/20~<br>112/03/26 | Market Risk VaR: the historical simulation approach |    |
| 7  | 112/03/27~<br>112/04/02 | Market Risk VaR: Model-Building Approach            |    |
| 8  | 112/04/03~<br>112/04/09 | Credit Risk: Estimating Default Probability         |    |
| 9  | 112/04/10~<br>112/04/16 | Merton's Model                                      |    |
| 10 | 112/04/17~<br>112/04/23 | 期中考試週   |    |

|              |                         |  |  |
|--------------|-------------------------|--|--|
| 11           | 112/04/24~<br>112/04/30 | Credit Risk Losses and Credit VaR  |  |
| 12           | 112/05/01~<br>112/05/07 | Scenario Analysis  |  |
| 13           | 112/05/08~<br>112/05/14 | Stress Testing   |  |
| 14           | 112/05/15~<br>112/05/21 | Liquidity Risk   |  |
| 15           | 112/05/22~<br>112/05/28 | 畢業考試週  |  |
| 16           | 112/05/29~<br>112/06/04 | ---  |  |
| 17           | 112/06/05~<br>112/06/11 | ---  |  |
| 18           | 112/06/12~<br>112/06/18 | ---  |  |
| 修課應<br>注意事項  |                         |  |  |
| 教學設備         |                         | 電腦、投影機   |  |
| 教科書與<br>教材   |                         | 財務風險管理-工具衡量與未來發展 陳達新 (雙葉) ; Fundamentals of Futures and Options Markets, John Hull   |  |
| 參考文獻         |                         |  |  |
| 批改作業<br>篇數   |                         | 10 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<br>計算方式 |                         | ◆出席率：            %   ◆平時評量：30.0 %   ◆期中評量：30.0 %<br>◆期末評量：40.0 %<br>◆其他〈 〉：            %   |  |
| 備考           |                         | 「教學計畫表管理系統」網址： <a href="https://info.ais.tku.edu.tw/csp">https://info.ais.tku.edu.tw/csp</a> 或由教務處<br>首頁→教務資訊「教學計畫表管理系統」進入。<br><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> |  |