

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	財務風險個案	授課 教師	李沃牆 LEE, WO-CHIANG
	FINANCIAL RISK-CASE STUDY		
開課系級	財金一碩專班 A	開課 資料	實體課程 選修 單學期 3學分
	TLBXJ1A		
課程與SDGs 關聯性	SDG8 尊嚴就業與經濟發展 SDG16 和平正義與有力的制度		
系 ( 所 ) 教育目標			
提供財務金融產業人才之專業訓練課程，以落實實務與理論融合應用之能力。			
本課程對應院、系(所)核心能力之項目與比重			
<p>A. 具備理論與實務融合應用之能力。(比重：30.00)</p> <p>B. 具備個案研究與分析的能力。(比重：10.00)</p> <p>C. 培養具備企業財務決策與分析之能力。(比重：5.00)</p> <p>D. 發展專業競爭的能力與態度。(比重：20.00)</p> <p>E. 提升財金研究理論與方法之素養。(比重：20.00)</p> <p>F. 提升考取高階財金專業證照之能力。(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：10.00)</p> <p>2. 資訊運用。(比重：10.00)</p> <p>3. 洞悉未來。(比重：10.00)</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	<p>本課程由風險管理的觀念著手，分別介紹市場風險、信用風險及作業風險的理論與模型、再透過國內外近幾年較為有名的財務風險個案進行分組討論，可讓學生瞭解風險的重要性及避險的必要性。</p>		

	The course first introduce the basic risk concepts, include the market risk ,credit risk and operation risk theory and models. We also to discuss the famous financial crisis cases. Students will understand the importance of risk and the necessity of hedging.
--	--

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	具備財務風險管理觀念	With financial risk knowledge
2	具備財務風險分析能力	With the analytic capability of financial risk
3	提升財務風險管理能力	Enhanced the management capability of financial 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	AC	1257	講述、討論	討論(含課堂、線上)、報告(含口頭、書面)、活動參與
2	認知	BDE	348	講述、討論	討論(含課堂、線上)、報告(含口頭、書面)
3	技能	ACF	567	講述、討論	討論(含課堂、線上)、報告(含口頭、書面)、活動參與

授課進度表

週次	日期起訖	內容 (Subject/Topics)	備註
1	112/02/13~ 112/02/19	課程介紹	
2	112/02/20~ 112/02/26	風險管理概述、分組報告說明	
3	112/02/27~ 112/03/05	新版巴塞爾協定與金融風險管理	
4	112/03/06~ 112/03/12	市場風險概述與風險值定義;投信的市場風險管理模式	
5	112/03/13~ 112/03/19	風險值模型與實作(1)	
6	112/03/20~ 112/03/26	風險值模型與實作(2) (實施遠距教學測試)	

7	112/03/27~ 112/04/02	風險值模型與實作(3) (實施遠距教學測試)	
8	112/04/03~ 112/04/09	(1)利率風險與資產負債管理(1)(2)財務風險個案2:	
9	112/04/10~ 112/04/16	期中報告與討論	
10	112/04/17~ 112/04/23	(1)利率風險與資產負債管理(2)(2)財務風險個案3:	
11	112/04/24~ 112/04/30	(1)信用風險與違約機率;投信的信用風險管理模式(2)財務風險個案4:	
12	112/05/01~ 112/05/07	(1)信用風險模型與實作(1) (2)財務風險個案6:	
13	112/05/08~ 112/05/14	(1)信用風險模型與實作(2) (2)財務風險個案7:	
14	112/05/15~ 112/05/21	(1)資產組合之信用風險評估與實作(2)財務風險個案8:	
15	112/05/22~ 112/05/28	(1)作業風險與評估;投信的作業,內控風險管理模式(2)財務風險個案9:	
16	112/05/29~ 112/06/04	(1)作業風險與評估;投信的作業,內控風險管理模式(2)財務風險個案10:	
17	112/06/05~ 112/06/11	分組報告與綜合討論	
18	112/06/12~ 112/06/18	教師彈性補充教學: (1)作業風險與評估;投信的作業,內控風險管理模式(2)財務風險個案11:	
修課應 注意事項	1.本課程注意分組討論 2.另有個人風險管理-氣功教學		
教學設備	電腦、投影機		
教科書與 教材	李沃牆(2023),財務風險個案,自編教材,講義		
參考文獻	陳錦村:風險管理概要-個案與實務		
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: 30.0 % ◆平時評量: % ◆期中評量: % ◆期末評量: % ◆其他〈分組報告〉: 70.0 %		
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 首頁→教務資訊「教學計畫表管理系統」進入。 <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>		