

淡江大學 114 學年度第 1 學期課程教學計畫表

| | | | |
|--|---|----------|------------------------|
| 課程名稱 | 財務風險控管 | 授課 教師 | 林建志 LIN, CHIEN-CHIN |
| | FINANCIAL RISK MANAGEMENT | | |
| 開課系級 | 財金四 P | 開課 資料 | 實體課程 選修 單學期 3學分 |
| | TLBXB4P | | |
| 課程與SDGs 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 | | | |
| A. 具備財務金融理論與實務的基本知識。(比重：35.00) B. 加強相關金融法規的學習。(比重：10.00) C. 培養財務金融職場的基本倫理與道德。(比重：20.00) D. 提升學生的國際觀與外語能力。(比重：10.00) E. 提升學生專業證照之能力。(比重：20.00) F. 具備分析國內外金融發展情勢之基本能力。(比重：5.00) | | | |
| 本課程對應校級基本素養之項目與比重 | | | |
| 1. 全球視野。(比重：10.00) 2. 資訊運用。(比重：10.00) 3. 洞悉未來。(比重：10.00) 4. 品德倫理。(比重：10.00) 5. 獨立思考。(比重：30.00) 6. 樂活健康。(比重：10.00) 7. 團隊合作。(比重：10.00) 8. 美學涵養。(比重：10.00) | | | |
| 課程簡介 | 本課程大致分成四部份：風險管理基礎、市場風險的衡量、信用風險的衡量與管理及財務風險管理的法規環境與未來展望。在風險管理部份我們將討論財務風險的意義。在市場風險的衡量部份，討論現今最重要的市場風險管理與衡量的方法—風險值。在信用風險的衡量與管理方面，介紹各種信用風險的衡量與管理工具。最後在財務風險管理的法規環境與未來展望這一部份，說明新版巴賽爾資本協定。 | | |

| | |
|--|---|
| | Class includes four parts: The foundations of risk management, market Risk, credit Risk and the regulation and prospection of risk measurement. In the part of the foundations of risk management, we will discuss the the meaning of risk management. In the part of market risk, we introduce the most important measurement for market risk—VaR. In the part of credit risk, we discuss the development of credit risk models. Finally, in the part of the regulation and prospection of risk measurement, Basel I & II are discussed. |
|--|---|

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 | 了解財務風險的分類、意義、限制與目的, 以及財務風險管理工具之演變與未來的發展。 | To understand the category, the meaning, the restriction and the goal of risk management. |
| 2 | 學習傳統市場風險衡量的技術及現今最重要的市場風險管理與衡量的方法—風險值 | To learn the classical technology for measuring risks, and the most important measurement for market risk—VaR |
| 3 | 學習各種信用風險的衡量與管理工具 | Study the measurement of credit risk, and develop credit risk models. |

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 |
| 2 | 認知 | ABCDEF | 12345678 | 講述、實作 | 測驗、作業 |
| 3 | 認知 | ABCDEF | 12345678 | 講述、實作 | 測驗、作業 |

授 課 進 度 表

| 週次 | 日期起訖 | 內 容 (Subject/Topics) | 備註 |
|----|-------------------------|----------------------|----|
| 1 | 114/09/15~ 114/09/21 | 財務風險概論 | |
| 2 | 114/09/22~ 114/09/28 | 財務風險管理的數理基礎 | |
| 3 | 114/09/29~ 114/10/05 | 加權股價指數 | |
| 4 | 114/10/06~ 114/10/12 | 期貨避險與最適避險比率 | |
| 5 | 114/10/13~ 114/10/19 | 選擇權 | |

| | | | |
|--------------|-------------------------|--|--|
| 6 | 114/10/20~ 114/10/26 | 選擇權:Delta 避險 | |
| 7 | 114/10/27~ 114/11/02 | 選擇權: Gamma、Rho、Theta | |
| 8 | 114/11/03~ 114/11/09 | 選擇權: 波動率與Vega | |
| 9 | 114/11/10~ 114/11/16 | 期中考試週 | |
| 10 | 114/11/17~ 114/11/23 | 市場風險 | |
| 11 | 114/11/24~ 114/11/30 | 風險值:歷史模擬法 | |
| 12 | 114/12/01~ 114/12/07 | 指數加權移動平均法 | |
| 13 | 114/12/08~ 114/12/14 | 蒙地卡羅模擬 | |
| 14 | 114/12/15~ 114/12/21 | 內建模型法 | |
| 15 | 114/12/22~ 114/12/28 | Cash flow mapping | |
| 16 | 114/12/29~ 115/01/04 | 期末多元評量週 | |
| 17 | 115/01/05~ 115/01/11 | 期末多元評量週/教師彈性教學週 | |
| 18 | 115/01/12~ 115/01/18 | 教師彈性教學週 | |
| 課程培養 關鍵能力 | | | |
| 跨領域課程 | | | |
| 特色教學 課程 | | | |
| 課程 教授內容 | | 邏輯思考 | |
| 修課應 注意事項 | | | |
| 教科書與 教材 | | 採用他人教材:教科書 教材說明: Fundamentals of futures and options markets | |
| 參考文獻 | | | |
| | | | |

| | |
|--------------|--|
| 學期成績 計算方式 | ◆出席率： 10.0 % ◆平時評量：30.0 % ◆期中評量：20.0 % ◆期末評量：30.0 % ◆其他〈期中、期末教學意見調查〉：10.0 % |
| 備 考 | 「教學計畫表管理系統」網址： https://web2.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。 ※「遵守智慧財產權觀念」及「不得非法影印、下載及散布」。請使用正版教科 書，勿非法影印他人著作，以免觸法。 |