

# 淡江大學114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							
課程與SDGs 關聯性	SDG1 消除貧窮 SDG8 尊嚴就業與經濟發展 SDG9 產業創新與基礎設施 SDG12 負責任的消費與生產							
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：30.00) B. 整合跨領域理論與實務的應用能力。(比重：10.00) C. 熟稔相關財金研究方法與成果。(比重：10.00) D. 具備獨立研究的學術能力。(比重：30.00) E. 提升學生的教學能力。(比重：10.00) F. 提升學術研究國際化之能力。(比重：10.00)								
本課程對應校級基本素養之項目與比重								
1. 全球視野。(比重：5.00) 2. 資訊運用。(比重：25.00) 3. 洞悉未來。(比重：5.00) 4. 品德倫理。(比重：20.00) 5. 獨立思考。(比重：30.00) 6. 樂活健康。(比重：5.00) 7. 團隊合作。(比重：5.00) 8. 美學涵養。(比重：5.00)								
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	1358	講述、討論	作業、討論(含課堂、線上)、報告(含口頭、書面)
2	情意	BEF	2367	講述、討論	作業、討論(含課堂、線上)、報告(含口頭、書面)
3	技能	CF	45	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	114/09/15~114/09/21	Introduction What is risk? Risk management?	
2	114/09/22~114/09/28	Financial Products and how they are used for hedging, Portfolio analysis & Matlab (Exercise 1)	
3	114/09/29~114/10/05	How traders manage their exposures	
4	114/10/06~114/10/12	Market Risk-Volatility(Exercise 3)	
5	114/10/13~114/10/19	Bank Regulation and Basel II	
6	114/10/20~114/10/26	Market Risk-VaR Model	

7	114/10/27~ 114/11/02	Market Risk-VaR Model(Exercise 4)	
8	114/11/03~ 114/11/09	1 Market Risk-VaR Model-.Extreme value theory	
9	114/11/10~ 114/11/16	Credit Risk: Estimating Default Probabilities	
10	114/11/17~ 114/11/23	期中考試週(Midterm)	
11	114/11/24~ 114/11/30	Credit Risk: Estimating Default Probabilities	
12	114/12/01~ 114/12/07	Credit Risk: Estimating Default Probabilities	
13	114/12/08~ 114/12/14	Credit Derivatives-1	
14	114/12/15~ 114/12/21	credit Deratives-2	
15	114/12/22~ 114/12/28	Operational Risk-1	
16	114/12/29~ 115/01/04	Operational Risk -2	
17	115/01/05~ 115/01/11	期末考週	
18	115/01/12~ 115/01/18	教學彈性週(線上學習)	
課程培養 關鍵能力	國際移動、人文關懷、問題解決、跨領域		
跨領域課程	STEAM課程(S科學、T科技、E工程、M數學，融入A人文藝術領域) 素養導向課程(探索素養、永續素養或全球議題STEEP(Society ,Technology, Economy, Environment, and Politics)) 授課教師專業領域教學內容以外，融入其他學科或邀請非此課程領域之專家學者進行知識(教學)分享		
特色教學 課程	專題/問題導向(PBL)課程		
課程 教授內容	程式設計或程式語言(學生有實際從事相關作業或活動) 邏輯思考 A I 應用 永續議題		
修課應 注意事項	no		
教科書與 教材	自編教材：簡報、講義 教材說明： 李沃牆(2024),自編講義		
參考文獻	Philippe Jorion(2007),Value at Risk,3nd,Mcgraw Hill (新月代理)		

學期成績 計算方式	<p>◆出席率： 20.0 % ◆平時評量： % ◆期中評量： %</p> <p>◆期末評量： 40.0 %</p> <p>◆其他〈報告, term paper〉： 40.0 %</p>
備 考	<p>「教學計畫表管理系統」網址：<a href="https://web2.ais.tku.edu.tw/csp">https://web2.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。</p> <p><b>※「遵守智慧財產權觀念」及「不得不法影印、下載及散布」。請使用正版教科書，勿不法影印他人著作，以免觸法。</b></p>