

淡江大學 99 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	路祥琛 Cheung-sum Lu
	FINANCIAL RISK MANAGEMENT		
開課系級	財金四 P	開課 資料	選修 單學期 3學分
	TBBXB4P		
學系(門)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。			
學生基本能力			
<p>A. 具備財務金融理論與實務的基本知識。</p> <p>B. 加強相關金融法規的學習。</p> <p>C. 培養財務金融職場的基本倫理與道德。</p> <p>D. 提升學生的國際觀與外語能力。</p> <p>E. 提升學生專業證照之能力。</p> <p>F. 具有國際化、資訊化、未來化之願景規劃基本能力。</p> <p>G. 具備審視國內外金融發展情勢之基本能力。</p> <p>H. 培訓學生獨立、因應及解決問題的基本能力。</p>			
課程簡介	介紹財務風險管理的概念及機制，並說明巴塞爾協定的內容。		
	This course provides an overview of the concepts and the mechanics of risk management, including detailed discussions of the Basel Accords.		

本課程教學目標與目標層級、學生基本能力相關性

一、目標層級(選填)：

- (一)「認知」(Cognitive 簡稱C)領域：C1 記憶、C2 瞭解、C3 應用、C4 分析、C5 評鑑、C6 創造
- (二)「技能」(Psychomotor 簡稱P)領域：P1 模仿、P2 機械反應、P3 獨立操作、P4 聯結操作、P5 自動化、P6 創作
- (三)「情意」(Affective 簡稱A)領域：A1 接受、A2 反應、A3 重視、A4 組織、A5 內化、A6 實踐

二、教學目標與「目標層級」、「學生基本能力」之相關性：

- (一)請先將課程教學目標分別對應前述之「認知」、「技能」與「情意」的各目標層級，惟單項教學目標僅能對應C、P、A其中一項。
- (二)若對應「目標層級」有1~6之多項時，僅填列最高層級即可(例如：認知「目標層級」對應為C3、C5、C6項時，只需填列C6即可，技能與情意目標層級亦同)。
- (三)再依據所訂各項教學目標分別對應該系「學生基本能力」。單項教學目標若對應「學生基本能力」有多項時，則可填列多項「學生基本能力」(例如：「學生基本能力」可對應A、AD、BEF時，則均填列)。

序號	教學目標(中文)	教學目標(英文)	相關性	
			目標層級	學生基本能力
1	介紹財務風險管理的基本概念。	Introduce the basic concept of risk management.	C2	A
2	詳細說明巴塞爾協定的內容。	Detailed discussion of the Basel Accords.	A4	ABDEG
3	討論風險衡量模型：VaR、Credit Metrics、MKMV、CreditRisk+。	Present some popular risk measurement models, such as VaR, Credit Metrics, MKMV, and CreditRisk+.	P5	ADG
4	介紹常用的信用衍生性商品。	Discuss some popular credit derivatives.	A3	ADG
5	介紹衡量操作風險的方法。	Introduce the operational risk measurement methods mentioned in the Basel Accord II.	P4	ABD
6	介紹專案融資的基本概念及過程。	Explain the process of project finance.	C4	ABD

教學目標之教學策略與評量方法

序號	教學目標	教學策略	評量方法
1	介紹財務風險管理的基本概念。	課堂講授、分組討論	出席率、討論、期中考
2	詳細說明巴塞爾協定的內容。	課堂講授、分組討論	出席率、討論、期中考
3	討論風險衡量模型：VaR、Credit Metrics、MKMV、CreditRisk+。	課堂講授、分組討論	出席率、討論、期中考、期末考
4	介紹常用的信用衍生性商品。	課堂講授、分組討論	出席率、討論、期末考
5	介紹衡量操作風險的方法。	課堂講授、分組討論	出席率、討論、期末考
6	介紹專案融資的基本概念及過程。	課堂講授、分組討論	出席率、討論、期末考

授課進度表

週次	日期	內容 (Subject/Topics)	備註
1	09/13	財務風險概論	
2	09/20	財務風險概論	
3	09/27	巴塞爾資本協定	第一次課堂討論
4	10/04	巴塞爾資本協定	
5	10/11	巴塞爾資本協定	
6	10/18	市場風險的衡量與管理	
7	10/25	市場風險的衡量與管理	
8	11/01	市場風險的衡量與管理	
9	11/08	市場風險的衡量與管理	
10	11/15	期中考試週	
11	11/22	信用風險的衡量與管理	
12	11/29	信用風險的衡量與管理	
13	12/06	信用風險的衡量與管理	
14	12/13	信用風險的衡量與管理	
15	12/20	信用風險的衡量與管理	
16	12/27	操作風險	
17	01/03	專案融資	
18	01/10	期末考試週	
修課應 注意事項	制式課程教學計畫表的欄位字數不足，請修課同學務必到教學支援平台閱讀“修課應注意事項”，了解自身的責任及權益。		
教學設備	電腦、投影機		
教材課本	財務風險管理，工具、衡量與未來發展（二版）- 陳達新與周恆志合著（雙葉書廊）。		

參考書籍	Risk Management – Crouhy, Galai, and Mark (McGraw-Hill). Elements of Financial Risk Management – Christoffersen (Academic Press). The Fundamentals of Risk Measurement – Marrison (McGraw-Hill). 風險管理新標竿，風險值理論與應用(再版) – 周大慶、沈大白、張大成、敬永康、柯瓊鳳合著(智勝文化)。 風險管理，風險值(VaR)理論與應用 – 李進生、謝文良、林允永、蔣旨坪、陳達新、盧陽正合著(清蔚科技)。
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	◆平時考成績：10.0 %   ◆期中考成績：40.0 %   ◆期末考成績：40.0 % ◆作業成績：            % ◆其他〈課堂討論〉：10.0 %
備 考	「教學計畫表管理系統」網址： <a href="http://info.ais.tku.edu.tw/csp">http://info.ais.tku.edu.tw/csp</a> 或由教務處 首頁〈網址： <a href="http://www.acad.tku.edu.tw/index.asp/">http://www.acad.tku.edu.tw/index.asp/</a> 〉教務資訊「教學計畫 表管理系統」進入。 <b>※非法影印是違法的行為。請使用正版教科書，勿非法影印他人著作，以免觸法。</b>