

淡江大學 99 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	選修 單學期 3學分
	TBBMD1A		
學系(門)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。			
學生基本能力			
<p>A. 奠定紮實的財務金融理論基礎。</p> <p>B. 整合跨領域理論與實務的應用能力。</p> <p>C. 熟稔相關財金研究方法與成果。</p> <p>D. 具備獨立研究的學術能力。</p> <p>E. 培養金融環境的分析能力。</p> <p>F. 提升學生的教學素質。</p> <p>G. 提升學術研究國際化之能力。</p> <p>H. 強化學術研究團隊合作能力。</p>			
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	具備財務風險理論與實務的基本知識	With financial risk theory and practice knowledge	C4	ACFH
2	增進風險管理的知識	Advanced knowledge in risk management.	P3	ABDH
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.	P3	ABCDH

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	具備財務風險理論與實務的基本知識	課堂講授、分組討論	出席率、報告、討論
2	增進風險管理的知識	課堂講授、分組討論	出席率、報告、討論
3	增進對市場風險,信用風險,作業風險的分析能力	課堂講授、分組討論	出席率、報告、討論

授課進度表

週次	日期	內容 (Subject/Topics)	備註
1	09/13	Introduction(Chapters 1) What is risk? Risk management?	
2	09/20	Financial Products and how they are used for hedging,Portfolio analysis (Chapters 2) (Exercise 1)	
3	09/27	How traders manage their exposures	
4	10/04	Market Risk-Volatility (Chapter 5) (Exercise 3)	
5	10/11	Bank Regulation and Basel II (Chapter 7)	

6	10/18	Market Risk-VaR Model((Chapter 8)	
7	10/25	Market Risk-VaR Model-(Chapter 9)-(Exercise 4)	
8	11/01	1 Market Risk-VaR Model-.Extreme value theory(Ch9)	
9	11/08	Credit Risk: Estimating Default Probabilities	
10	11/15	期中考試週(Midterm)	
11	11/22	Credit Risk: Estimating Default Probabilities	
12	11/29	Credit Risk: Estimating Default Probabilities	
13	12/06	Credit Derivatives (Chapter 13)	
14	12/13	Correlation and Copula(Chapter 6-2)	
15	12/20	Operational Risk (Chapter 14)-1	
16	12/27	Operational Risk (Chapter 14)-2	
17	01/03	Data Mining in Credit Risk-Introduction	
18	01/10	期末考試週(Final Exam)	
修課應 注意事項			
教學設備	電腦		
教材課本	1. John Hull(2010), Risk Management and Financial Institutions , 2nd, Pearson Prentice Hall(雙葉書局代理) 2 Lee,Wo-Chiang(2010),Lecture Note		
參考書籍	3 Philippe Jorion(2007),Value at Risk,3nd,Mcgraw Hill (新月代理)		
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：20.0 %   ◆期中考成績：        %   ◆期末考成績：        % ◆作業成績： 40.0 % ◆其他〈報告, term paper〉：40.0 %		
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>		