

淡江大學 99 學年度第 2 學期課程教學計畫表

課程名稱	風險管理	授課 教師	王偉弘 Wei-hong Wang
	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	<p>(1)財務風險管理簡介： 包含財務風險管理的認識，股票、固定收益證券、期貨、外匯、選擇權等金融工具的簡介，以及學習財務風險管理需具備的數學基礎等等。</p> <p>(2)市場風險的計算與衡量： 包含衡量市場風險的傳統工具介紹，VaR的介紹與計算等等。</p> <p>(3)信用風險模型介紹： 包含衡量信用風險的傳統工具介紹，Merton、KMV等信用風險模型的介紹等等。</p>		
	<p>(1)Introduction the financial risk management: they include financial risk management for financial institutions from the regulator's, risk manager's, treasurer's and stockholders' perspectives.</p> <p>(2)Introduction to the market risk: they include measurement of market risk, e.g. compute VaR etc.</p> <p>(3)Introduction to the credit risk: they include measurement of credit risk, the Merton model, the KMV model etc.</p>		

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	本課程採理論與實務並重的原則，期望透過授課，使學生了解如市場風險、信用風險、作業風險等財務風險管理的基本觀念，學習如風險值的計算、信用風險模型等風險管理的分析方法，以具備管理金融風險的基本能力。	Discuss the art of risk management for financial institutions from the regulator's, risk manager's, treasurer's and stockholders' perspectives. The various risk measurement models will also be introduced.	C2	AEFH

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	本課程採理論與實務並重的原則，期望透過授課，使學生了解如市場風險、信用風險、作業風險等財務風險管理的基本觀念，學習如風險值的計算、信用風險模型等風險管理的分析方法，以具備管理金融風險的基本能力。	課堂講授	出席率、小考、期中考、期末考

授課進度表

週次	日期起訖	內容 (Subject/Topics)	備註
1	100/02/14~100/02/20	課程介紹、Chapter 1 財務風險概論	講解
2	100/02/21~100/02/27	Chapter 2 財務風險管理的數理基礎	講解
3	100/02/28~100/03/06	Chapter 2 財務風險管理的數理基礎	講解
4	100/03/07~100/03/13	Chapter 3 貨幣與金融市場交易工具, Chapter 4 風險管理的工具：衍生性金融商品	講解
5	100/03/14~100/03/20	Chapter 5 市場風險衡量：傳統工具 vs. VaR	講解

6	100/03/21~ 100/03/27	Chapter 5 市場風險衡量：傳統工具 vs. VaR,Chapter 6 風險值的種類以及計算方法(上)	講解,測驗(1)
7	100/03/28~ 100/04/03	Chapter 6 風險值的種類以及計算方法(上)	講解
8	100/04/04~ 100/04/10	Chapter 7 風險值的種類以及計算方法(下)	講解
9	100/04/11~ 100/04/17	Chapter 7 風險值的種類以及計算方法(下)	講解
10	100/04/18~ 100/04/24	期中考試週	
11	100/04/25~ 100/05/01	Chapter 8 信用風險的起因與傳統衡量工具	講解
12	100/05/02~ 100/05/08	Chapter 8 信用風險的起因與傳統衡量工具	講解
13	100/05/09~ 100/05/15	Chapter 9 信用風險計量模型(一)	講解,測驗(2)
14	100/05/16~ 100/05/22	Chapter 9 信用風險計量模型(一)	講解
15	100/05/23~ 100/05/29	Chapter 10 信用風險計量模型(二)	講解
16	100/05/30~ 100/06/05	Chapter 10 信用風險計量模型(二)	講解
17	100/06/06~ 100/06/12	Chapter 11 巴塞爾資本協定之沿革與規定	講解
18	100/06/13~ 100/06/19	期末考試週	
修課應 注意事項	平時測驗：原則上測驗2至4次，期中考以前測驗1~2次，期末考以前測驗1~2次。 出席率：視上課情況與人數進行點名。		
教學設備	電腦、投影機		
教材課本	陳達新、周恆志 合著，財務風險管理—工具、衡量與未來發展，第2版，2010年6月，雙葉書廊出版。		
參考書籍	1.P. Jorion, 2009, "Financial Risk Manager Handbook," 5th ed, Wiley & Son, 秀鶴行有限公司代理。 2.金融風險管理，第4版，Jorion 原著，陳勝源 譯，2009年5月出版，寰宇出版股份有限公司發行。 3.金融機構風險管理，杜建衡 著，2009年3月出版，新陸書局發行。		
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：30.0 % ◆期末考成績：40.0 % ◆作業成績： % ◆其他〈出席率〉：10.0 %		

備 考	<p>「教學計畫表管理系統」網址：http://info.ais.tku.edu.tw/csp 或由教務處首頁〈網址：http://www.acad.tku.edu.tw/index.asp/〉教務資訊「教學計畫表管理系統」進入。</p> <p>※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。</p>
-----	---