

淡江大學 99 學年度第 2 學期課程教學計畫表

課程名稱	金融風險管理	授課 教師	邱瑋如
	FINANCIAL RISK MANAGEMENT		
開課系級	財金進學班四 A	開課 資料	選修 單學期 2學分
	TBBXE4A		
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>本課程主要在介紹金融風險之範疇、種類與財務工具，以及在金融風暴發生後各國政府所合作制定的巴賽爾資本協定和其他相關法規。最重要的是運用統計學相關風險衡量工具模擬現況將風險值量化，以降低金融風險，健全銀行、企業及國家的金融體系。</p>		
	<p>This course introduces the theory of financial risk management. It provides a general framework of the background, causes and possible solutions to the recent financial crisis. It uses statistics to create measuring models and RiskMetrics to estimate the probability of market and credit risk.</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	了解財務風險管理的分類、意義、限制與目的。	To know the theory of financial risk management and how to quantify the invisible financial risk.	C2	ACH
2	理解金融風暴發生之背景、成因以及因應而生之法規。	Understand the background of the subprime crisis and the content of the Basel Accords.	C2	BF
3	運用統計概念與量化模型衡量市場與信用風險。	Use financial instruments to estimate the potential financial risk in a variety of methods.	P3	AH

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	了解財務風險管理的分類、意義、限制與目的。	課堂講授	報告、小考、期中考
2	理解金融風暴發生之背景、成因以及因應而生之法規。	課堂講授、分組討論	報告、小考、期中考
3	運用統計概念與量化模型衡量市場與信用風險。	課堂講授	小考、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	課程簡介及課程評量方式介紹	
2	100/02/21~100/02/27	金融風險管理概述	
3	100/02/28~100/03/06	金融風暴背景、成因與後續影響	

4	100/03/07~ 100/03/13	巴賽爾資本協定	
5	100/03/14~ 100/03/20	貨幣與金融市場交易工具	
6	100/03/21~ 100/03/27	衍生性金融商品	
7	100/03/28~ 100/04/03	新型態風險管理工具	
8	100/04/04~ 100/04/10	分配函數與迴歸分析	
9	100/04/11~ 100/04/17	期中報告	
10	100/04/18~ 100/04/24	期中考試週	
11	100/04/25~ 100/05/01	金融風險管理分類簡述	
12	100/05/02~ 100/05/08	金融風險--市場風險	
13	100/05/09~ 100/05/15	市場風險計量模型I	
14	100/05/16~ 100/05/22	市場風險劑量模型II	
15	100/05/23~ 100/05/29	金融風險--信用風險	
16	100/05/30~ 100/06/05	信用風險計量模型I	
17	100/06/06~ 100/06/12	信用風險計量模型II	
18	100/06/13~ 100/06/19	期末考試週	
修課應 注意事項			
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，陳達新/周恆志，第二版，民國99年，雙葉書廊。	
參考書籍			
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： % ◆期中考成績：30.0 % ◆期末考成績：40.0 % ◆作業成績： 30.0 % ◆其他〈 〉： %	

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>
----	---