

淡江大學 99 學年度第 2 學期課程教學計畫表

課程名稱	財務風險管理	授課 教師	陳志偉
	MANAGEMENT OF FINANCIAL RISK		
開課系級	財金在職班四 A	開課 資料	選修 單學期 2學分
	TBBXK4A		
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>自2008年次貸風暴所引起的金融海嘯以來，金融業風險管理即為顯學。本課程說明金融機構風險管理之最佳實務運作方式，內容包括整體風險管理(ERM)架構、各類風險管理機制(主要為市場風險及信用風險)、風險管理資訊系統、績效評估、Basel II/III之講解，並透過投資組合風險值(VaR)計算模組來加強教學效果。</p>		
	<p>From the Financial Crisis triggered by Subprime Mortgage Crisis in 2008, the FI's risk management becomes apparently important. This course will guide students to understand the best practices of risk management at Financial Institutes. It covers the topics such as Enterprise Risk Management(ERM) architecture, main control mechanisms of risk management(including market risk and credit risk), risk management MIS, Basel II/III etc. The teaching effect will be enhanced by introducing the portfolio VaR computing example.</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	1. 瞭解風險管理基本觀念。 2. 瞭解各類風險管理機制之最佳實務運作方式。 3. 熟悉投資組合風險值(VaR)計算模組。	1. Understand basic risk management concepts. 2. Understand the best practices of risk management operations. 3. Be familiar with computing modules of the portfolio VaR.	C4	ABCDEFGH

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	1. 瞭解風險管理基本觀念。 2. 瞭解各類風險管理機制之最佳實務運作方式。 3. 熟悉投資組合風險值(VaR)計算模組。	課堂講授	出席率、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	財務風險管理簡介	
2	100/02/21~ 100/02/27	市場風險管理	
3	100/02/28~ 100/03/06	風險值(VaR)介紹	
4	100/03/07~ 100/03/13	金融商品介紹	
5	100/03/14~ 100/03/20	投資組合風險值案例計算	
6	100/03/21~ 100/03/27	敏感度分析、回溯測試、壓力測試	

7	100/03/28~ 100/04/03	信用風險管理-1	
8	100/04/04~ 100/04/10	信用風險管理-2	
9	100/04/11~ 100/04/17	作業風險管理+流動性風險管理	
10	100/04/18~ 100/04/24	期中考試週	
11	100/04/25~ 100/05/01	Basel II及Basel III 介紹-1	
12	100/05/02~ 100/05/08	Basel II及Basel III 介紹-2	
13	100/05/09~ 100/05/15	風險管理資訊系統介紹-1	
14	100/05/16~ 100/05/22	風險管理資訊系統介紹-2	
15	100/05/23~ 100/05/29	資本配置+績效評估-1	
16	100/05/30~ 100/06/05	資本配置+績效評估-2	
17	100/06/06~ 100/06/12	金融控股公司風險管理委員會運作實務	
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		1. 周大慶、沈大白、張大成、敬永康、柯瓊鳳 "風險管理新標竿：風險值理論與應用(再版)" 2007，智勝文化事業有限公司	
參考書籍		1. 陳達新、周恆志 "財務風險管理：工具、衡量與未來發展" 2010(二版)，雙葉書廊 2. "銀行自有資本之計算與自有資本標準之國際通則" 2005, 財團法人台灣金融研訓院 3. Jorion, P. (2009), "Financial Risk Manager Handbook", 5th ed., Wiley. 4. Jorion, P. (2007), "Value at Risk: The New Benchmark for Managing Financial Risk", 3rd ed., McGraw-Hill. (新月/東華 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：35.0 % ◆期末考成績：35.0 % ◆作業成績： % ◆其他〈出席率〉：10.0 %	

備 考

「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。

※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。