

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	劉洪鈞 Hung-chun Liu
	MANAGEMENT OF FINANCIAL RISK		
開課系級	財金一碩士班 A	開課 資料	必修 單學期 3學分
	TBBMM1A		
學系(門)教育目標			
以完整進階的財務金融課程，培養具獨立分析、判斷與解決問題的財務專業人才。			
學生基本能力			
<p>A. 培養進階財務金融理論的知識。</p> <p>B. 提升應用理論與實務技巧。</p> <p>C. 加強邏輯推演的能力。</p> <p>D. 財金研究方法的學習與運用。</p> <p>E. 具備表達、組織與應用能力。</p> <p>F. 強化學生溝通與解決問題的能力。</p> <p>G. 提升考取高階財金專業證照之能力。</p> <p>H. 具備學術未來深造的潛力。</p>			
課程簡介	<p>最近，由美國次級房貸風暴所引發的全球金融海嘯，造成投資人鉅額的損失、影響成千上萬的投資銀行，甚至使得全球的金融體系瀕臨瓦解。全球金融海嘯事件再次凸顯風險管理的重要性。鑑此，本課程將介紹財務風險管理的要義，並呈現財務風險管理的基本理論與最新發展，讓學生可以在最短的時間內掌握財務風險管理的新趨勢。更重要的，一些常見的風險衡量模型亦在本課程中一併作介紹。</p>		
	<p>The objective of this course is to use concise approach by introducing not only the essential concepts of financial risk management but also presenting their basic theories and their newly developments for students to handle the trend of financial risk management. More importantly, several standard approaches for the measurement of risk exposure associated with a particular portfolio of assets are also presented.</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	財務風險概念介紹	Introduction of financial risk management	C2	ABH
2	風險衡量工具	Instruments for risk measurement	P3	BDH
3	實務案例應用	Application to practical issues	P6	BCDFH

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	財務風險概念介紹	課堂講授、分組討論	出席率、報告、討論
2	風險衡量工具	課堂講授、分組討論	出席率、報告、討論
3	實務案例應用	課堂講授、分組討論	報告、討論

授課進度表

週次	日期起訖	內容 (Subject/Topics)	備註
1	100/02/14~ 100/02/20	Introduction of financial risk management	
2	100/02/21~ 100/02/27	Literature review for volatility estimation & forecasting (I)	
3	100/02/28~ 100/03/06	Literature review for volatility estimation & forecasting (II)	
4	100/03/07~ 100/03/13	Volatility estimators & parametric volatility models (I)	
5	100/03/14~ 100/03/20	Volatility estimators & parametric volatility models (II)	

6	100/03/21~ 100/03/27	Practical illustration for volatility estimation & forecasting (I)	
7	100/03/28~ 100/04/03	Practical illustration for volatility estimation & forecasting (II)	
8	100/04/04~ 100/04/10	Report & discussion (I)	
9	100/04/11~ 100/04/17	Midterm	
10	100/04/18~ 100/04/24	Volatility application: Value-at-Risk (I)	
11	100/04/25~ 100/05/01	Volatility application: Value-at-Risk (II)	
12	100/05/02~ 100/05/08	Practical illustration for Value-at-Risk	
13	100/05/09~ 100/05/15	Report & discussion (II)	
14	100/05/16~ 100/05/22	Volatility application: Option valuation (I)	
15	100/05/23~ 100/05/29	Volatility application: Option valuation (II)	
16	100/05/30~ 100/06/05	Practical illustration for option prices forecasts	
17	100/06/06~ 100/06/12	Report & discussion (III)	
18	100/06/13~ 100/06/19	Final	
修課應 注意事項			
教學設備		電腦、投影機	
教材課本			
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：30.0 % ◆期中考成績：30.0 % ◆期末考成績：30.0 % ◆作業成績： % ◆其他〈出席率, 學習態度〉：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。	