

## 1002學期 課程基本資料/Course Information

系所 / 年級	財金系碩士班 2年級	課號 / 班別	87M00056 / B
學分數	3學分	選 / 必修	選修
科目中文名稱	財金風險管理	科目英文名稱	Financial Risk Management
主要授課老師	蔡豐澤	開課期間	一學年之下學期
人數上限	10 人	已選人數	3人

## 起始週 / 結束週 / 上課地點 / 上課時間

第1週 / 第18週 / M513 / 星期三第02節  
 第1週 / 第18週 / M513 / 星期三第03節  
 第1週 / 第18週 / M513 / 星期三第04節

請各位同學遵守智慧財產權觀念；請勿非法影印。  
 Please observe Intellectual Property Rights (IPR), not to make illegal copies.

## 教學綱要/syllabus

## 第一部分/Part I(※依課程委員會審議之內容決議填入)

	基本素養/核心能力 Core Literacy/Core Competencies	相關性 Relevance	
		高度相關	中度相關
一、教學目標所要達成之能力培養項目： 【依據課程委員會審議通過之課程與基本素養/核心能力關聯表填寫】	職業倫理	.	<input type="checkbox"/>
	合作創新	.	<input type="checkbox"/>
	資訊分析	<input type="checkbox"/>	.
	溝通協調	.	<input type="checkbox"/>
	財金專業	<input type="checkbox"/>	.

1.認知面：[使學生理解、應用、分析、綜合、比較、推論、評估本課程之理論與概念]：

The purpose of this course is to help students be familiar with risk measure methods, tools and models. In addition, students will learn how to manage all kinds of risks, including market risk, credit risk, liquidity risk, operational risk and others.

2.技能面[使學生能獲得運用與實做本課程理論與概念之技巧]：

This course reviews many quantitative analysis techniques and introduces important risk models.

3.情意面[能引發學生對本課程之興趣，激發學生學習動機，增加觸類旁通與自主學習]：

The goal of this course is to instill concept and knowledge of risk management and to assist students in preparing Financial Risk Manager (FRM) certification exams.

三、符合教學目標之課程內容設計

Risk measure tools, Risk models, Market risk, Credit risk, Liquidity risk, Operational risk

四、先修科目  
(Pre Course)

Financial management, Investment, Futures & Options

第二部分/Part II

- 一、多元教學方法 (Teaching Method)
- |   |  |  |   |  |
|---|--|--|---|--|
| <input type="checkbox"/> 由學生自訂學習目標與抱負水準 | <input type="checkbox"/> 服務學習            | <input type="checkbox"/> 學生課後書面報告        | <input type="checkbox"/> 案例或故事討論          | <input checked="" type="checkbox"/> 講述   |
| <input type="checkbox"/> 學生上台報告         | <input checked="" type="checkbox"/> 習題練習 | <input checked="" type="checkbox"/> 腦力激盪 | <input type="checkbox"/> 小組討論             | <input type="checkbox"/> 參訪              |
| <input type="checkbox"/> 審議式民主          | <input type="checkbox"/> 影片欣賞與討論         | <input type="checkbox"/> 觀察與資料收集         | <input checked="" type="checkbox"/> 學生實作  | <input type="checkbox"/> 角色演練            |
|   |  |  | <input type="checkbox"/> 採訪               | <input checked="" type="checkbox"/> e化教學 |
|   |  |  | <input checked="" type="checkbox"/> 一分鐘回饋 | <input checked="" type="checkbox"/> 其他   |

- 二、參考書目 (Reference)
1. Risk Management and Financial Institutions, John C. Hull, 2nd Ed., Pearson
2. Financial risk manager handbook plus test bank :FRM Part I/Part II, Philippe Jorion, 6th Ed., Wiley & Sons

三、教學進度 (Syllabi)

[符合教學目標之教學進度]

2012/2/22	Course Introduction	蔡豐澤
2012/2/29	Risk Management	蔡豐澤
2012/3/7	Fundamentals of Probability	蔡豐澤
2012/3/14	Fundamentals of Statistics	蔡豐澤
2012/3/21	Monte Carlo Methods	蔡豐澤
2012/3/28	In-class Test, Modelling Risk Factors	蔡豐澤
2012/4/4	Holiday	蔡豐澤
2012/4/11	Introduction to Risk Models	蔡豐澤
2012/4/18	Mid-term Exam	蔡豐澤
2012/4/25	Managing Linear Risk	蔡豐澤
2012/5/2	Nolinear Risk Models	蔡豐澤
2012/5/9	In-class Test, Advanced Risk Models: Univariate	蔡豐澤
2012/5/16	Advanced Risk Models: Multivariate	蔡豐澤
2012/5/23	Managing Volatility Risk	蔡豐澤
2012/5/30	In-class Test, Introduction to Credit Risk	蔡豐澤
2012/6/6	Liquidity Risk	蔡豐澤
2012/6/13	Operational Risk	蔡豐澤
2012/6/20	Final Exam	蔡豐澤

評量方式	分數	評量方式	分數
<input type="checkbox"/> 實作測驗	0	<input checked="" type="checkbox"/> 期中筆試	30
<input checked="" type="checkbox"/> 隨堂筆試測驗	40	<input checked="" type="checkbox"/> 期末筆試	30
<input type="checkbox"/> 小組作業	0	<input type="checkbox"/> 期中報告	0
<input type="checkbox"/> 服務日誌	0	<input type="checkbox"/> 期末報告	0
<input type="checkbox"/> 口試	0	<input type="checkbox"/> 專題報告	0
<input type="checkbox"/> 個人上台報告	0	<input type="checkbox"/> 實作作品與反思	0
<input type="checkbox"/> 小組上台報告	0	<input type="checkbox"/> 前後測比較進步與成長	0
<input type="checkbox"/> 出席狀況	0	<input type="checkbox"/> 課堂參與與表現	0
<input type="checkbox"/> 心得與反思報告	0	<input type="checkbox"/> 其他	0

五、講義位址 (http://) [E Learning](http://)

[回上頁](#) [重新查詢](#)