

重新查詢

友善列印

### 0981學期 課程基本資料

系所 / 年級	財金系碩士班 2年級	課號 / 班別	87M00030 / A
學分數	3學分	選 / 必修	選修
科目中文名稱	金融機構管理專題	科目英文名稱	Topics in Financial Institution and Management
主要授課老師	蔡永順	開課期間	一學年之上學期
人數上限	20 人	已選人數	10人

### 起始週 / 結束週 / 上課地點 / 上課時間

第1週 / 第18週 / M416 / 星期1第05節  
第1週 / 第18週 / M416 / 星期1第06節  
第1週 / 第18週 / M416 / 星期1第07節

請各位同學遵守智慧財產權觀念；請勿非法影印。

### 教學綱要

- 一、教學目標(Objective) 讓同學了解金融機構風險的種類、衡量、管理，以及新議題討論。
- 二、先修科目(Pre Course) 金融機構管理
- 三、教材內容(Outline) 金融機構風險管理、信用風險、利率風險、市場風險、作業風險、資本適足率、存款保險、BASEL
- 四、教學方式(Teaching Method) 講授、案例分析、投影片、報告、討論
- 五、參考書目(Reference) 金融風險管理-第四版，Jorin著，陳勝源譯

1900/1/1	市場風險衡量之介紹	蔡永順
1900/1/1	市場風險之來源	蔡永順
1900/1/1	線性風險之避險	蔡永順
1900/1/1	非線性風險	蔡永順
1900/1/1	建立風險因子模型	蔡永順
1900/1/1	VAR方法	蔡永順
1900/1/1	投資組合管理	蔡永順
1900/1/1	避險基金風險管理	蔡永順

六、教學進度(Syllabi)	1900/1/1	信用風險介紹	蔡永順
	1900/1/1	違約風險之精算衡量	蔡永順
	1900/1/1	從市場價格衡量違約風險	蔡永順
	1900/1/1	信用曝險額	蔡永順
	1900/1/1	信用衍生性商品	蔡永順
	1900/1/1	信用風險管理	蔡永順
	1900/1/1	作業風險	蔡永順
	1900/1/1	風險資本與風險調整後資本報酬	蔡永順
	1900/1/1	公司全面風險管理	蔡永順
	1900/1/1	期末考	蔡永順

七、評量方式(Evaluation) 平時、present、報告

八、講義位址(<http://>)

九、教育目標

重新查詢