朝陽科技大學 095學年度第1學期教學大綱
Financial Risk Management 金融風險管理

當期課號	1179	Course Number	1179
授課教師		Instructor	
中文課名	金融風險管理	Course Name	Financial Risk Management
開課單位	企業管理系(四日)四A	Department	
修習別	選修	Required/Elective	Elective
學分數	3	Credits	3
課程目標	風險管理的蓬勃發展，可追溯自1970年代起，源自於金融市場的自由化、全球化與金融創新的快速發展，使金融機構所面臨的經營環境日益複雜，經營風險不斷升高。本課程以系統化架構，介紹現代金融風險的管理理論與方法，藉由期貨遠期契約選擇權交換等衍生性金融工具(商品)之介紹說明，分析各項金融商品與衍生性金融工具及其風險來源、特性、風險衡量與管理方法。內容涵蓋市場風險、信用風險、匯率風險與利率風險等相關風險構面，對於有志於成爲金融機構從業人員的學生而言，應有相當的助益。	Objectives	"Financial Risk Management" provides an introduction to risk management, an area with increasing importance in both modern financial academia and financial industry. The course will focus on risk management using derivative securities. The main objectives of "Financial Risk Management" are to introduce the basic concepts and methodologies of risk management using derivative securities, including options, futures, forwards, and swaps; and provide students with an introduction to the basic characteristics and valuation of various derivative securities, and explore the applications of derivatives to manage various risks such as market risk, currency risk, interest rate risk, and credit risk.
教材	1.台灣金融研訓院風險管理理論與方法編輯委員會編撰，風險管理理論與方法，台灣金融研訓院出版，民國九十四年一月。 2.每週六之經濟日報(必須取得紙版，全版面閱讀)。	Teaching Materials	GARP, "FRM Test Study Guide," GARP, 2006.
成績評量方式	1.期中─分組(分14組)書面報告(60%)，題目：「台灣地區OO金控業者之風險管理策略與公司治理之專題報告」以Word程式撰寫編輯，以標楷體與Times New Roman字體12點編排，A4紙列印，毋須封面，但必須編列頁碼，並於首頁上方註名本篇報告名稱與全組同學姓名及學號，全篇報告以六頁爲限，繳交日期爲校定期中考週之後的第四週上課日。 2.期末─分組(同期中報告之14組)口頭報告(30%)，題目：「台灣地區OO金控業者之風險管理策略與公司治理之專題報告」以期中報告內容與老師建議之修正方向爲基礎，採PowerPoint程式編輯投影片(十分鐘)，組內每位同學皆須輪流上台報告，接受同學與老師之質詢，並負回答問題之責任。 3.平常成績(10%)─以出席率與課程內容參與程度定奪之。	Grading	1.Report 60% 2.Oral 30% 3.Class Participation 10%
教師網頁			
	風險管理的蓬勃發展可追溯自1970年代起，源自於金融市場的自由化、全球化與金融創新的快速發展，使金融機構所面臨的經營環境日益複雜，經營風險不斷升高；直至1990年代，紛紛傳出因業者的風險管理不善，導致多家金融業者或是操作衍生性金融工具進行避險或投機行爲的其他機構(包括製造業與政府機構等)，發生營運危機或破產倒閉事件，故相		The Course: “Financial Risk Management” provides an introduction to risk management, an area with increasing importance in both modern financial academia and financial industry. The course will focus on risk management using derivative securities. The main objectives of “Financial Risk Management” are to introduce the

教學內容	對進一步促使對現代金融風險管理的省思與改革。時至今日，風險管理的系統化、科學化與複雜化的趨勢，明顯改變了金融業的樣貌；再者，以巴塞爾銀行監理委員會爲首的國際金融監理當局，強調金融機構應建立有效的內部風險管理控制機制，揭櫫以「最低資本需求」、「監理審查程序」與「市場紀律」爲三大風險管理支柱，即形成「Basel Ⅱ」的巴塞爾的新資本協定與金融風險管理架構之頒布，確立了風險管理爲金融機構經營的核心地位，並爲金融從業人員必備的一門知識。基於風險管理結合管理、經濟、財務、統計與數學等多項學科知識，本課程企圖以系統化架構採深入淺出方式介紹現代金融風險的管理理論與方法。即由基礎的統計概念與財務現值法爲出發點，藉此分析各項金融商品與衍生性金融工具及其風險來源、特性、風險衡量與管理方法，內容涵蓋市場、信用與作業三大風險構面，應可對於有志於成爲金融機構從業人員的學生而言，應有相當的助益。 課程進度： 第一週　基礎機率與統計概念 第二週　現值與利率關係 第三、四週　衍生性金融商品 第五、六週　選擇權市場 第七週　固定收益證券 第八週　固定收益型之衍生性金融商品 第九週　權益證券市場 第十週　外匯與商品市場 第十一、十二週　風險避險策略 第十三週　市場風險的來源 第十四週　市場風險衡量的方法 第十五週　信用風險介紹 第十六週　衡量違約風險-精算法 第十七週　信用風險衡量--市場價值法 第十八週　信用衍生性商品與作業風險	**Syllabus**	basic concepts and methodologies of risk management using derivative securities, including options, futures, forwards, and swaps; and provide students with an introduction to the basic characteristics and valuation of various derivative securities, and explore the applications of derivatives to manage various risks such as market risk, currency risk, interest rate risk, and credit risk. 1. Quantitative Analysis 2. Market Risk Measurement and Management 3.Credit Risk Measurement and Management 4.Operational, Integrated Risk & Legal, Accounting & Ethics 5.Risk Management in Investment Management

尊重智慧財產權，請勿非法影印。