朝陽科技大學 096學年度第1學期教學大綱
Financial Risk Management 金融風險管理

當期課號	1186	Course Number	1186
授課教師	李宗政	Instructor	LEE,CHUNG CHENG
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(初版)，民國九十四年一月。 2.每週六之經濟日報(必須取得紙版，全部版面閱讀)。	Teaching Materials	Financial Risk Management Handbook - 4th Edition
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二週上課日。 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	Term paper 60% Oral 30% Class aprticipation 10%
教師網頁			
教學內容	第一週　基礎機率與統計概念 第二週　現值與利率關係 第三週　衍生性金融商品 第四週　選擇權市場 第五週　固定收益證券 第六週　固定收益型之衍生性金融商品 第七週　權益證券市場 第八週　外匯與商品市場 第九週　風險避險策略	Syllabus	This class guide summarizes the core body of knowledge for financial risk managers, covering such topics as: • Quantitative methods • Capital markets • Credit, operational, market, and integrated risk management • Investment management and hedge fund risk

	第十週　市場風險的來源 第十一週　市場風險衡量的方法 第十二週　信用風險介紹、衡量違約風險-精算法 第十三週　信用風險衡量--市場價值法 第十四週　作業風險		• Relevant regulatory, legal, and accounting issues essential to risk professionals

尊重智慧財產權，請勿非法影印。