

朝陽科技大學
100學年度第1學期教學大綱

當期課號	7602	中文科名	金融機構風險管理專題
授課教師	蘇真慧	開課單位	保險金融管理系
學分數	3	修課時數	3
開課班級	碩士班1年級 A班		
修習別	專業選修		
類別	一般課程		

本課程與系所培養學生核心能力關聯度	高度關聯	中高關聯	中度關聯	中低關聯	低度關聯
運用基礎課程知識之能力。			✓		
保險金融之專業能力。	✓				
職場倫理與道德及人文關懷。			✓		
國際視野與終身學習能力。		✓			

本課程培養學生下列知識：

本課程內容以金融機構之風險管理為核心議題，涵蓋市場風險、信用風險與作業風險等衡量模型與實務運作。

- 1.了解金融機構風險管理之意涵
- 2.熟悉市場風險之衡量
- 3.熟悉信用風險之衡量
- 4.具備成為金融風險管理人才之能力

This course covers related topics on risk management of financial institutions, including market risk, credit risk, operation risk and capital requirements.

每週授課主題

- 第01週：課程介紹; 金融市場概論
- 第02週：現值與利率關係
- 第03週：衍生性金融商品; 選擇權市場
- 第04週：固定收益證券及相關衍生性金融商品
- 第05週：權益證券市場
- 第06週：外匯與商品市場
- 第07週：避險
- 第08週：市場風險的來源與衡量方法
- 第09週：市場風險的衡量(續)
- 第10週：信用風險介紹及衡量
- 第11週：信用風險的衡量(續)
- 第12週：作業風險
- 第13週：風險性資本與績效衡量
- 第14週：模型風險
- 第15週：小組報告一
- 第16週：小組報告二
- 第17週：小組報告三
- 第18週：期末考

成績及評量方式

- 期末考：40%
- 口頭報告：40%
- 平時作業及出席：20%

證照、國家考試及競賽關係

- 金融風險管理人員

主要教材

- 2.風險管理理論與方法, 台灣金融研訓院編譯委員會(教科書)
- 3.風險管理, 台灣金融研訓院編譯委員會(教科書)

參考資料

書名：銀行自有資本之計算與自有資本標準之國際通則 作者：新巴賽爾資本協定共同研究小組 出版年(西元)：出版社：台灣金融研訓院

建議先修課程

本課程無建議先修課程

教師資料

教師網頁：<http://www.cyut.edu.tw/~chsu/>

E-Mail：chsu@cyut.edu.tw

Office Hour：

星期三,第5~6節,地點:R-204;

星期四,第3~4節,地點:R-204;

分機:7305、4506

[關閉](#) [列印](#)

尊重智慧財產權，請勿不法影印。