

**朝陽科技大學**  
**102學年度第1學期教學大綱**

當期課號	7068	中文科名	金融機構風險管理專題
授課教師	張永郎	開課單位	保險金融管理系
學分數	3	修課時數	3
		開課班級	日間部碩士班1年級 A班
修習別	專業必修		
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
保險金融理論與實務結合之專業能力。			✓		
保險經營管理之專業能力。	✓				
金融風險管理之專業能力。	✓				
職場倫理與道德及人文關懷能力。			✓		
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：Syllabus and presentation arrangement
- 第02週：The introduction of financial institutions
- 第03週：The introduction of financial institutions risk ma
- 第04週：Interest risk
- 第05週：Market risk and credit risk
- 第06週：Credit risk and Off-Balance-Sheet risk
- 第07週：Sovereign Risk
- 第08週：Liquidity Risk
- 第09週：Mid-term
- 第10週：Paper: Counterparty credit risk
- 第11週：Paper: Counterparty credit risk
- 第12週：Paper: Longevity risk
- 第13週：Paper: Longevity risk
- 第14週：Paper: Sovereign risk
- 第15週：Paper: Bank loan
- 第16週：Paper: system crisis
- 第17週：Paper: Deposit insurance
- 第18週：Proposal presentation

**成績及評量方式**

- Mid-term：30%
- Paper presentation：35%
- Proposal presentation：20%
- Participation：15%

**證照、國家考試及競賽關係**

- 金融風險管理人員

**主要教材**

1. Journal papers (JF, JFE, JBF, JFI, JRI, and so on)(教科書)
2. Saunders and Cornett, Financial Institutions Management: A Risk Management Approach(教科書)

**參考資料**

本課程無參考資料!

### 建議先修課程

1.Financial institution

### 教師資料

教師網頁：<http://lms.ctl.cyut.edu.tw/2008233>

E-Mail：[vcchang@cyut.edu.tw](mailto:vcchang@cyut.edu.tw)

Office Hour：

星期二,第3~4節,地點:R-228;

星期四,第3~4節,地點:R-228;

分機:7824、7824

[\[關閉\]](#) [\[列印\]](#)

尊重智慧財產權，請勿不法影印。