

朝陽科技大學
106學年度第2學期教學大綱

當期課號	7013	中文科名	投資管理
授課教師	陳弘吉	開課單位	財務金融系
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能力指標關聯度：

核心能力	能力指標	關聯度		
		高度關聯	中度關聯	低度關聯
財金理論與實務專業之能力。	提供貴賓級客戶理財規劃分析及境外資產管理。			✓
研究分析與規劃執行之能力。	分析、研究各類型金融商品之市場資訊及未來趨勢，隨時掌握投資市場的脈動。	✓		
倫理道德與社會責任之能力。	描述公司治理與企業財務的關係。	✓		
國際視野與外國語言之能力。	使用國內外商情資料庫蒐集資料，並彙整及分析中英文相關文獻。		✓	
國際視野與外國語言之能力。	撰寫中英文書面報告及進行口頭簡報。		✓	

本課程培養學生下列知識：

本課程旨在探討投資的各項風險管理。本課程之主要內容如下：1、市場風險 2、信用風險 3、資產負債表外交易風險 4、外匯風險 5、主權與技術及其他作業風險 6、流動性風險及負債與流動性管理 7、資本適足性

1. 熟悉市場風險
2. 熟悉信用風險
3. 熟悉資產負債表外交易風險
4. 熟悉外匯風險
5. 熟悉主權與技術及其他作業風險
6. 熟悉流動性風險及負債與流動性管理
7. 熟悉資本適足性

This course will focus on risks of investments. These readings will be both theoretical and empirical in nature.

每週授課主題

- 第01週：第十章.市場風險
- 第02週：第十章.市場風險
- 第03週：第十一章.信用風險(一)
- 第04週：第十一章.信用風險(一)
- 第05週：第十二章.信用風險(二)
- 第06週：校慶補假
- 第07週：第十三章.資產負債表外交易風險
- 第08週：第十三章.資產負債表外交易風險
- 第09週：第十四章.外匯風險
- 第10週：第十四章.外匯風險
- 第11週：第十五章.主權(國家)風險
- 第12週：第十六章.技術與其他作業風險
- 第13週：第十七章.流動性風險
- 第14週：第十七章.流動性風險
- 第15週：第十八章 負債與流動性管理
- 第16週：第十八章 負債與流動性管理
- 第17週：第二十章.資本適足性
- 第18週：期終考

成績及評量方式

期末考：50%
出席及課堂參與：50%

證照、國家考試及競賽關係

- 理財規劃人員
- 證券商高級業務員

主要教材

1. Financial Institutions Management -A Risk Management Approach Saunders&Cornett,張春雄、胡勝益導讀東華書局6e(教科書)

參考資料

本課程無參考資料!

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://lms.cit.cyut.edu.tw/2003106>

E-Mail：hcc5689@yahoo.com.tw

Office Hour：

分機：

[關閉](#) [列印](#)

尊重智慧財產權，請勿不法影印。