

朝陽科技大學
109學年度第2學期教學大綱

當期課號	1096	中文科名	金融風險管理
授課教師	金鐵英	開課單位	財務金融系
學分數	3	修課時數	3
		開課班級	日間部四年制4年級 A班
修習別	專業選修		
類別	一般課程		

本課程培養學生下列知識：

金融風險管理是一門討論金融風險的概論性課程，旨在於介紹金融風險的基礎觀念，以及目前風險管理所慣用的方法與技巧。

1. 認識金融風險管理的基本觀念
2. 認識現貨金融商品的風險管理
3. 認識期貨金融商品的風險管理
4. 認識選擇權金融商品的風險管理
5. 認識全方位金融避險與風險管理

This lecture is an introductory course for financial risk management. In this lecture, we will introduce the fundamental concepts of financial risks and investigate the prevailing methods and skills for financial risk management.

每週授課主題

- 第01週：The Need for Risk Management
- 第02週：Lessons from Financial Disasters
- 第03週：Regulatory Capital Standards with VaR
- 第04週：Measuring Financial Risk
- 第05週：Computing value at Risk
- 第06週：Backtesting VaR Models
- 第07週：Portfolio Risk: Analytical Methods
- 第08週：Forecasting Risks and Correlations
- 第09週：VaR Methods
- 第10週：Stress Testing
- 第11週：Implementing Delta-Normal VaR
- 第12週：Simulation Methods
- 第13週：Credit Risk
- 第14週：Final Examination
- 第15週：課程補救教學
- 第16週：實施畢業典禮
- 第17週：Class Reviews 線上教學
- 第18週：就業輔導與追蹤

成績及評量方式

Assignment：40%
Test：50%
Attendance：10%

證照、國家考試及競賽關係

- 企業風險管理師

主要教材

1. 吳俊德 許強 外匯資金管理暨衍生性金融商品 華泰書局 978-957-609-770-6 2017 第8版(教科書)

參考資料

本課程無參考資料!

建議先修課程

1. Futures and Options

教師資料

教師網頁：<http://www.cyut.edu.tw/~tieinjin/>
E-Mail：tieinjin@cyut.edu.tw

Office Hour :

星期二,第5~6節,地點:T2-919;

星期四,第5~6節,地點:T2-919;

分機:

[\[關閉\]](#) [\[列印\]](#)

尊重智慧財產權，請勿不法影印。