

朝陽科技大學
112學年度第2學期教學大綱

當期課號	7013	中文科名	風險管理專題
授課教師	林宗漢	開課單位	財務金融系
學分數	2	修課時數	2
		開課班級	日間部碩士班1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：

本課程主要在於介紹風險管理中市場風險與信用風險的概念，及分別說明衡量市場風險與信用風險的方式，並藉由國內外風險管理文獻的研討，讓同學能夠掌握國內外相關的文獻，進而建立風險管理議題研究的脈絡。

- 1.了解市場風險的概念
- 2.熟悉風險值的概念及計算
- 3.掌握國內外風險值相關的文獻
- 4.了解信用風險的概念
- 5.熟悉信用事件概念及信用風險的計算
- 6.掌握國內外信用風險的相關文獻
- 7.建立風險管理議題研究的脈絡

This course mainly introduces the concepts of market risk and credit risk in risk management, and explains the methods of measuring market risk and credit risk respectively. Through the discussions of risk management literature both domestically and internationally, students will gain an understanding of relevant literature, enabling them to establish the context for research on risk management topics.

每週授課主題

- 第01週：風險管理介紹
- 第02週：市場風險衡量—風險值介紹
- 第03週：風險值的種類及計算風險
- 第04週：專題研討(一)
- 第05週：信用風險介紹
- 第06週：專題研討(二)
- 第07週：信用事件與信用損失
- 第08週：專題研討(三)
- 第09週：期中報告
- 第10週：信用評等與信用評等移轉矩陣
- 第11週：專題研討(四)
- 第12週：主權評等
- 第13週：專題研討(五)
- 第14週：內部評等法介紹
- 第15週：專題研討(六)
- 第16週：期末報告(一)
- 第17週：期末報告(二)
- 第18週：線上非同步課程

成績及評量方式

- 課堂參與：30%
- 專題研討：40%
- 期中報告：10%
- 期末報告：20%

證照、國家考試及競賽關係

本課程無證照、國家考試及競賽資料。

主要教材

- 1.財務風險管理陳達新、周恆志雙葉書廊2018第四版(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://www.cyut.edu.tw/~t2008285/>

E-Mail：t2008285@cyut.edu.tw

Office Hour：

星期二,第5~6節,地點:R-237;

星期三,第3~4節,地點:R-237;

分機:4797、7095

[\[關閉\]](#) [\[列印\]](#)

尊重智慧財產權，請勿不法影印。