

開南管理學院 91 年度第 2 學期 財務金融 學系科目教學計劃表

科目代碼	科目名稱	授課教師	修別	開課年級	學分數	每週時數
	中文：企業風險管理	孫效孔	<input type="checkbox"/> 必修 <input checked="" type="checkbox"/> 選修	3 年 班	3	3
	英文：Enterprise Risk Management	先修課程				
教學目標與內容	企業風險管理 (Enterprise Risk Management, ERM) 之訓練，乃是為了降低管理及財務作業損失，增加企業競爭力。尤其是當經濟景氣低迷之時，緊縮支出成爲企業當務之急。風險管理正是降低企業成本之要素，因而成爲左右企業成敗之關鍵。企業內舉凡財務、資訊、工程、業務乃至客戶服務等各部門，均須培養獨立之風險管理技術與因應機制。過去，風險管理之內容，太過偏向於保險業之定義。因此，廣義之企業及財務風險，將是本課程之重心。本課程之目的爲：(1) 瞭解基本之現代企業風險管理觀念 (2) 計算或度量企業之總體風險以及部門之各別作業風險 (3) 學習降低風險之各種技巧 (4) 規劃各部門之風險管理策略及方案					
實施方法	<input checked="" type="checkbox"/> 講解法。 <input type="checkbox"/> 實作法。 <input checked="" type="checkbox"/> 討論法。 <input checked="" type="checkbox"/> 演習法。 <input checked="" type="checkbox"/> 問答法。 <input type="checkbox"/> 其他 ()。					
評量方式	期中測驗 30%。期末測驗 30%。平時成績 20%。其他 報告 成績 20%。					
授課使用及參考書籍	「Fundamentals of Risk Measurement」, Chris Marrison, McGraw Hill, 2002 (新陸書局, 平裝本) - (教科書)					
	「風險管理新標準—風險值理論與應用」, 周大慶、沈大白、張大成、敬永康、柯瓊鳳合著 (智勝) - (參考)					
科目簡介(可含大綱及教學進度)：						
2/19 風險管理導論I — Basics, Economic Capital of Risks, RAROC						
2/26 風險管理導論II — Review of Statistics, Traded Instruments						
3/5 市場風險度量 — Market Risk Measurement						
3/12 風險值三大方法 — Three Approaches of VaR						
3/19 風險值之應用 — Application of VaR						
3/26 市場風險管理 — Management of Market Risk						
4/2 期中複習						
4/9 期中考試						
4/16 學期報告企劃檢討						
4/23 資產負債管理I — Introduction and Interest Rate Risks of Asset Liability Management						
4/30 資產負債管理II — Liquidity Risks, Funds-Transfer Pricing and ALM Risks						
5/7 信用風險管理I — Introduction and Credit Structure						
5/14 信用風險管理II — Risk Measurement for Single Facility						
5/21 信用風險管理III — Estimating Parameter Values						
5/28 風險資本與營運風險 — Regulation on Risk Based Capital and Operating Risks						
6/4 學期報告檢討						
6/11 期末複習						
6/18 期末考試						
說明：1. 授課教師於學期前填寫本表經課程委員會審核後，影印分送給教師所屬課程委員會召集人，授課班級所屬系、所及教務處課務組；並於開始上課時，將本內容向學生說明。2. 本表於91.4.23第四次校課程委員會討論通過。						

課程委員會召集人：



胡

授課教師：

孫效孔

Teacher name