



課 綱 Course Outline

經濟學系碩士班

中文課程名稱 Course Name in Chinese		風險分析與銀行管理				
英文課程名稱 Course Name in English		Risk Analysis and Bank Management				
科目代碼 Course Code		IIE_56700	班 別 Degree	碩士班 Master' s		
修別 Type		選修 Elective	學分數 Credit(s)	3.0	時 數 Hour(s)	3.0
先修課程 Prerequisite		none				
課程目標 Course Objectives						
A good risk management is critical for a modern bank. In this course, the various risk management techniques will be introduced to manage the financial risk banks faced						
系教育目標 Dept.' s Education Objectives						
1.	以經濟理論做理性分析與推理，以計量方法支持其推理及預測。					
2.	撰寫清楚精確的技術報告					
3.	思路清晰辯才無礙，有能力與人溝通分析的結果。					
系專業能力 Basic Learning Outcomes				課程目標與系專業能力相關性 Correlation between Course Objectives and Dept.' s Education Objectives		
A.	數理分析能力：通曉各種經濟學的理論技巧，應用數學與賽局解決經濟議題的能力。					
B.	實證經濟分析能力：通曉各種經濟學的實證技巧，善用資訊科技進行資訊蒐集、資料統計與計量分析。					
C.	微觀經濟之闡釋能力：通曉各種個體經濟學相關的理論與應用。					
D.	宏觀經濟之闡釋能力：通曉各種總體經濟學相關的理論與應用。					
E.	樂活能力：具備適應現代社會的學養以及就業能力。					
F.	溝通表達能力：思路清晰辯才無礙，有能力與人溝通並撰寫清楚精確的技術報告。					
圖示說明Illustration：● 高度相關 Highly correlated ○ 中度相關 Moderately correlated						
課程大綱 Course Outline						
1、Introduction to financial risk bank encounters						

2、Interest rate risk 3、Market risk 4、Credit risk 5、Off-balance-Sheet activities risk 6、Operational and technological risk 7、Foreign exchange risk 8、Sovereign risk 9、Liquidity risk 10、Asset and liability management 11、Capital adequacy 12、Model risk 13、Value at risk 14、Derivatives to manage risk - futures and forwards 15、Derivatives to manage risk - options, floors, and collars 16、Derivatives to manage risk - swaps 17、Securitization
資源需求評估（師資專長之聘任、儀器設備的配合．．．等） Resources Required (e.g. qualifications and expertise, instrument and equipment, etc.)
課程要求和教學方式之建議 Course Requirements and Suggested Teaching Methods
本課程以講授方式進行。
其他 Miscellaneous