

國立東華大學
教學計劃表 Syllabus

課程名稱(中文) Course Name in Chinese	信用風險專題			學年/學期 Academic Year/Semester	114/1
課程名稱(英文) Course Name in English	Credit Risk Topic				
科目代碼 Course Code	FIN_52730	系級 Department & Year	碩士	開課單位 Course-Offering Department	財務金融學系
修別 Type	選修 Elective	學分數/時間 Credit(s)/Hour(s)		3.0/3.0	
授課教師 Instructor	/呂進瑞				
先修課程 Prerequisite					
課程描述 Course Description					
信用風險為關係人的某一方有可能違約支付的風險。本課程介紹信用風險的評估模型及管理方式，學習者可以獲得如何管理信用風險知識及方法。特別以財務模型、數理模型、銀行管理、及衍生性工具等面向，評估信用風險。本課程以量化的風險分析，確認信用風險的水準及預測評估，以利投資人及企業經營者進行風險評估與管控。					
課程目標 Course Objectives					
Credit risk analysis is a relatively new field that is enjoying a rapid growth in popularity amongst businesses and governments world-wide. This course focuses on the credit risks. Specifically, this course emphasizes the applications and developments of mathematical models, statistical methods, financial analysis of credit risk. Moreover, this course provides some special interesting discussions on credit risk. We also provide analysis methods for graduate students					
圖示說明Illustration：● 高度相關 Highly correlated ○ 中度相關 Moderately correlated					
授課進度表 Teaching Schedule & Content					
週次Week	內容 Subject/Topics				備註Remarks
1	信用風險的意義				
2	信用風險的意義				
3	測量信用風險				
4	測量信用風險				
5	資產價值模型				
6	信用矩陣				
7	信用矩陣				
8	信用衍生性證券				
9	期中考試週 Midterm Exam				
10	信用衍生性證券				
11	信用評等				
12	衍生性商品的交易對手風險				
13	衍生性商品的交易對手風險				
14	銀行的信用風險				

15	CD0	
16	Credit VaR	
17	Credit VaR	
18	期末考試週 Final Exam	

教 學 策 略 Teaching Strategies

- ☒ 課堂講授 Lecture
 ☒ 分組討論 Group Discussion
 ☐ 參觀實習 Field Trip
☐ 其他 Miscellaneous:

教 學 創 新 自 評 Teaching Self-Evaluation

創新教學(Innovative Teaching)

- ☒ 問題導向學習(PBL)
 ☐ 團體合作學習(TBL)
 ☐ 解決導向學習(SBL)
☐ 翻轉教室 Flipped Classroom
 ☐ 磨課師 Moocs

社會責任(Social Responsibility)

- ☐ 在地實踐 Community Practice
 ☐ 產學合作 Industry-Academia Cooperation

跨域合作(Transdisciplinary Projects)

- ☐ 跨界教學 Transdisciplinary Teaching
 ☐ 跨院系教學 Inter-collegiate Teaching

- ☐ 業師合授 Courses Co-taught with Industry Practitioners

其它 other:

學期成績計算及多元評量方式 Grading & Assessments									
配分項目 Items	配分比例 Percentage	多元評量方式 Assessments							
		測驗 會考	實作 觀察	口頭 發表	專題 研究	創作 展演	卷宗 評量	證照 檢定	其他
平時成績(含出缺席) General Performance (Attendance Record)	5%	✓		✓					
期中考成績 Midterm Exam	30%	✓							
期末考成績 Final Exam	40%	✓							
作業成績 Homework and/or Assignments	25%		✓						
其他 Miscellaneous (_____)				✓					
評量方式補充說明 Grading & Assessments Supplemental instructions Google Meet: https://meet.google.com/gyz-qywe-ywu									
教科書與參考書目(書名、作者、書局、代理商、說明) Textbook & Other References (Title, Author, Publisher, Agents, Remarks, etc.) 講義									
課程教材網址(含線上教學資訊,教師個人網址請列位於本校內之網址) Teaching Aids & Teacher's Website(Including online teaching information. Personal website can be listed here.) 東華e學苑 Google Meet: https://meet.google.com/yft-jypf-rho									
其他補充說明 (Supplemental instructions) 無									