

97-2 Preliminary Syllabus, Da-Yeh Univ

Information			
Title	財務風險管理	Serial No. / ID	1947 / FBM3011
Dept.	財務金融學系	School System / Class	大學日間部3年1班
Lecturer	賴奕豪	Full or Part-time	專任
Required / Credit	Optinal / 3	Graduate Class	NO
Time / Place	(四)2 / B207 (五)34 / B207	Language	Chinese

Introduction
Financial Risk Management

Outline
課程說明、證照考試說明、財務風險管理概論 (SCEP)
2. 財務風險管理的數理基礎 (PS)
3. 貨幣與金融市場交易工具 (P)
4. 風險管理的工具：衍生性金融商品 (P)
5. 市場風險的衡量：傳統工具 vs VaR (風險值) (P)
6. 風險值的種類及計算方法：變異數共變異數法、歷史模擬法、蒙地卡羅法 (PS)
7. 信用風險的起因與傳統衡量工具 (P)
8. 信用風險計量模型 (PS)
9. 巴賽爾資本協定之沿革與規定 (EP)
10. 全方位風險管理與新型態風險管理工具 (PS)

Prerequisite
Statistics、