



MFB 每月課程總結

日期：111 年 3 月

課程名稱：金融風險管理

助教姓名：林詩茜



課程大綱



一、 基礎知識

■ 金融商品與金融市場

- 金融商品的分類、金融商品的交易、基本金融商品的價格
- 金融市場、金融交易模式

■ 金融機構

- 券商、信託業者、保險公司、商業銀行、其他

■ 金融監理、中央銀行與金融基礎設施



課程大綱



■ 金融體系

- 台灣的金融體系概要與觀察
- 基本金融商品介紹
- 金融市場介紹

■ 基本金融商品

- 複利與折現
- 利率與期限
- 債券價格與折現因子



課程大綱



■ 利率與期限

- 利率期限結構
- 期間的計時單位
- Nelson-Seigel 即期利率函數與模型設定



MFB每月課程總結

日期：111年 4 月

課程名稱：金融風險管理

助教姓名：林詩茜



課程大綱



■ 銀行的財務報表與金融商品會計

- 資產負債表、損益表、金融商品會計
- IAS 39 與 IFRS 9 之下金融商品的會計分類與評價

■ 銀行的風險、風險管理與金融監理：

- 銀行的風險類型、風險的辨識與衡量
- 風險監控、財報與風險管理、銀行

■ 風險管理、金融監理、巴賽爾資本協議



課程大綱



■ 遠期的基本理論

- 遠期市場與遠期價格
- 遠期契約的特點
- 標的資產之確定收益

■ 遠期外匯契約

- 換匯交易

■ 以利率為標的物的衍生性金融商品

- LIBOR
- 遠期利率協定
- 浮動利率債券



課程大綱



■ 利率

- LIBOR的發展
- 何謂 SOFR

■ 金融商品的特殊交易模式

- 金融商品的信用交易
- 保證金制度的操作
- 金融商品的附條件交易



課程大綱



■ 投資報酬率

- 複利化的報酬率：有效年收益率 EAR
- 統計學的報酬率：平均報酬率

■ 風險與報酬

- 風險的種類
- 市場風險溢酬
- 效率前緣與無異曲線
- 股票與外匯的評價
- Demo：各種總體經濟指標與壓力測試



課程大綱



■ 期貨的基本理論

- 期貨的交易
- 保證金制度與逐日結算

■ 期貨的類型

- 股票期貨
- 外匯期貨
- 利率期貨

■ 避險

- 避險的基本概念
- 使用遠期契約進行避險
- 使用期貨契約進行避險



MFB每月課程總結

日期：111年 5 月

課程名稱：金融風險管理

助教姓名：林詩茜



課程大綱



■ 金融體系

- 金融市場
- 直接金融與間接金融
- 金融商品的分類：債權工具
- 債券的風險與發行機構、信用評等、擔保與保證
- 債券的利息與本金
- 附加不同契約條款的公司債



課程大綱

■ 股權工具

- 普通股、特別股
- 指數股票型基金與外國存托憑證

■ 權益資本、負債與資產

- 風險與資本、資本適足
- 債券的求償順序
- 股權工具與債券工具的異同

■ 國際金融商品

- 外匯、跨國債券



課程大綱

- 長期與短期金融商品
 - 短期金融商品
 - 長期金融商品
- 貨幣市場與資本市場
- 金融商品的交易
 - 交易目的與避險
- 基本金融商品的價格
 - 利率
 - 折現率



課程大綱

■ 基本金融商品的價格

- 指標利率LIBOR
- 匯率
- 匯率指數
- 股價指數

■ 金融市場

- 證券市場
- 初級、次級市場
- 外匯市場



課程大綱

■ 金融市場

- 國際收支帳
- 匯率制度
- 境外金融市場



MFB 每月課程總結

日期：111年 6 月

課程名稱：金融風險管理

助教姓名：林詩茜



課程大綱



■ 金融機構

- 金融市場的參與者介紹
- 券商、信託業者、保險公司、商業銀行與其他五類

■ 金融交易模式

- 附條件交易與信用交易



課程大綱

■ 金融監理

- 金融監理的必要性與影響
- 中央銀行的貨幣政策
- 中央銀行的外匯市場監控與監督
- 貨幣市場與金融危機



課程大綱

■ 金融基礎設施

- 資金移轉支付系統
- 零售支付系統
- 支付系統的清算機制
- 證券清算系統與交易資訊儲存系統
- 附條件交易與信用交易



課程大綱

■ 金融監理

- 金融監理的必要性與影響
- 中央銀行的貨幣政策
- 中央銀行的外匯市場監控與監督
- 貨幣市場與金融危機