

课程大纲

课程编号：02812490 授课对象：金融硕士
课程名称：金融风险管理 英文名称：Financial Risk Management
周学时/总学时：3/36 学 分：2
任课教师：陈佳 开课学期：2012 年秋
先修课程：

任课教师联系方式：办公电话：62767941. Email: jia.chen@gsm.pku.edu.cn

辅导、答疑时间：

一、项目培养目标

学习目标 1 教授学生最新的金融学、经济学和管理学的理论知识，培养学生综合运用理论知识和解决实际金融问题的能力。

具体目标 1 系统掌握金融学、经济学和管理学的理论知识

具体目标 2 掌握数量化与分析问题的能力

具体目标 3 能够综合应用所学的理论知识和方法解决实际问题

学习目标 2 培养学生良好的沟通能力，使之适应在各类金融机构和企业的工作。

具体目标 1 具备良好的口头交流

具体目标 2 具备良好的书面交流能力

具体目标 3 具备良好的团队合作精神

学习目标 3 具有良好的社会责任感和伦理道德观

学习目标 4 具有国际化的视野

具体目标 1 理解金融的商业环境存在文化差异

具体目标 2 了解全球不同的金融体系

具体目标 3 适应在跨国金融机构有效工作。

二、课程概述

本课程为金融学硕士生的选修课程。本课程旨在培养学生评估和管理风险的能力。金融风险将是本课程的重点。企业全面风险管理的思路和方法将是贯穿本课程的主题。

三、课程目标（包括学生所提高的技能要求），本课程目标如何服务于项目的培

养目标

本课程结束时，学生们会对怎样评估和管理金融机构的整体风险有直观的理解，并有能力计算一个金融机构的整体风险。

四、内容提要及学时分配

本课程首先介绍风险管理有助于提高企业价值的原因，然后提出利用风险管理提高企业价值的总体框架。基于这个框架，本课程将介绍怎样评估和管理市场风险，现金流风险，利率风险，信用风险，以及经营风险。在学生熟悉了各种风险之后，本课程将转而讨论怎样评估和管理总的企业整体风险。此过程的重点是怎样用企业整体风险管理的方法来评估绩效和做公司决策。最后，本课程会讨论与风险管理有关的时事。

五、教学方式

教学方式以课堂教学为主。学生将完成课后作业以及小组案件。

六、教学过程中 IT 工具等技术手段的应用

教学方式以课堂教学为主。学生将完成课后作业以及小组案件。

七、教材

八、参考书目

Risk Management and Financial Institutions, Second Edition, by John C. Hull, Prentice Hall

Risk Management and Derivatives, by René M. Stulz, Thomson Southwestern Publishing Company

九、教学辅助材料，如 CD、录影等

辅助材料将包括一个由四部分组成的案例。这个案例涵盖企业整体风险的各个部分。

十、课程学习要求及课堂纪律规范

个人作业将由每个学生独立完成。小组作业由小组分工完成。

像每一个学术机构，我们有时可能遇到学术不端行为。学生和教师有义务报告可疑的学术不端行为。学生可以向老师或者有关领导报告涉嫌违反学术诚信的行为。所有的报告会在对情况保密和对所有当事人保护的原则下追查。

十一、学生成绩评定办法（需详细说明评估学生学习效果的方法）

作业：125 分

期终考试：125 分

课堂参与：50

总分：300 分