

上海建桥学院课程教学进度计划表

一、基本信息

| | | | |
|------|---|------|--------------------|
| 课程代码 | 2060805 | 课程名称 | 金融风险管理 |
| 课程学分 | 3 | 总学时 | 48 |
| 授课教师 | 梁艳 | 教师邮箱 | 15041@gench.edu.cn |
| 上课班级 | 金融工程 B21-1、2 金融工程 B21-1 (专升本) | 上课教室 | 2 教 204 |
| 答疑时间 | 周四中午 11:40-13:00, 周三中午 11:40-13:00 | | |
| 主要教材 | 金融风险管理 郭战琴, 李永奎 著 机械工业出版社 2021 年第 1 版 | | |
| 参考资料 | <p>【Value at Risk: The New Benchmark for Managing Financial Risk Philippe Jorion 著 McGraw-Hill Professional Press 2006 年第 3 版】</p> <p>【Quantitative Risk Management: Concepts, Techniques and Tools Alexander J. McNeil 著 Princeton University Press 2005 年第 1 版】</p> <p>【Python 金融风险管理 FRM 姜伟生、涂升著 清华大学出版社 2021 年第 1 版】</p> <p>【金融风险管理 朱淑珍著 北京大学出版社 2020 年第 4 版】</p> | | |

二、课程教学进度

| 周次 | 教学内容 | 教学方式 | 作业 |
|-----|--|--------|------|
| 1/1 | 1.1 风险与金融风险 1.2 风险、损失与不确定性 1.3 风险管理的流程和方法 1.4 风险管理方法的演变 | 讲课、讨论课 | |
| 1/2 | 1.5 金融机构的功能和分类 1.6 银行业的主要风险类型 1.7 评估风险管理过程 | 讲课 | |
| 2/1 | 2.1 刻画随机变量 2.2 随机变量：均值、方差、偏度和峰度 2.3 正态分布和对数正态分布 | 讲课、讨论课 | 习题 1 |
| 3/1 | 2.4 如何计算投资的回报：收益率 2.5 如何计算投资的风险：标准差 | 讲课 | |

注：课程教学进度计划表电子版公布在本学院课程网站上，并发送到教务处存档。

| | | | |
|------|--|--------|------|
| 3/2 | 3.1 单个风险证券投资 3.2 两个风险资产的投资组合 3.3 两个风险资产组合的有效边界 | 讲课、讨论课 | |
| 4/1 | 3.4 多个风险资产构成的投资组合 3.5 为什么组合多元化可以降低风险 3.6 无风险借贷与市场均衡 3.7 套利定价理论 | 讲课 | |
| 5/1 | 4.1 测度风险：一个历史视角 4.2 VaR 的定义 4.3 VaR 的计算：基于连续分布 4.4 VaR 的计算：基于离散分布 | 讲课 | |
| 5/2 | 4.5 增量 VaR 与边际 VaR 4.6 VaR 与预期亏损 4.7 风险一致性度量 | | |
| 6/1 | 4.8 谱风险测度 4.9 VaR 的参数选择 | 讲课 | |
| 7/1 | 5.1 定义波动率 5.2 时间的平方根法则 5.3 自相关性对 VaR 的影响 | 边讲边练 | |
| 8/1 | 5.4 风险的时间序列与 ARCH 模型 5.5 EWMA 模型和 GARCH (1,1) 模型 | 讲课 | 习题 2 |
| 9/1 | 6.1 金融衍生品的概念 6.2 市场参与者的类型 6.3 远期 6.4 期货 | 讲课、讨论课 | |
| 9/2 | 6.5 互换 6.6 期权 | 讲课、讨论课 | |
| 10/1 | 6.7 管理线性风险：对冲 | 讲课 | |
| 11/1 | 6.8 非线性风险管理：希腊值 | 讲课 | |
| 11/2 | 6.9 期权的 VaR | 讲课、讨论课 | |

注：课程教学进度计划表电子版公布在本学院课程网站上，并发送到教务处存档。

| | | | |
|------|--|---------|------|
| 12/1 | 7.1 资本的定义及作用 7.2 《巴塞尔协议》的前世今生 7.3 资本的分类和构成 | 讲课、课堂互动 | |
| 13/1 | 7.4 资本充足率监管 7.5 杠杆率：以风险为基础的 | 讲课、课堂互动 | 习题 3 |
| 13/2 | 8.1 传统信用风险管理 8.2 信用风险度量 8.3 度量违约风险的精算法 | 讲课、课堂互动 | |
| 14/1 | 8.4 度量违约风险的市场价格法 8.5 信用风险组合管理 8.6 交易对手风险管理 | 讲课、课堂互动 | |
| 15/1 | 8.4 度量违约风险的市场价格法 8.5 信用风险组合管理 8.6 交易对手风险管理 | 讲课、课堂互动 | |
| 15/2 | 9.1 操作风险定义 9.2 操作风险评估：损失分布法 9.3 操作风险的管理 | 讲课、课堂互动 | |
| 16/1 | 9.1 操作风险定义 9.2 操作风险评估：损失分布法 9.3 操作风险的管理 | 讲课、课堂互动 | |

三、评价方式以及在总评成绩中的比例

| 总评构成 (1+X) | 评价方式 | 占比 |
|---------------|--------|-----|
| 1 | 期终闭卷考 | 60% |
| X1 | 课堂表现 | 20% |
| X2 | 小论文 | 10% |
| X3 | 小组项目报告 | 10% |

注：课程教学进度计划表电子版公布在本学院课程网站上，并发送到教务处存档。

SJQU-QR-JW-011 (A0)

任课教师：梁艳

系主任审核：

注：课程教学进度计划表电子版公布在本学院课程网站上，并发送到教务处存档。