

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 B20-2 金融工程 B20-1 金融工程 B20-1 (专升本) 金融工程 B20-2 (专升本)	上课教室	1 教 318
答疑时间	周四中午 11:40-13:00, 周三中午 11:00-12:40		
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

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。

3/1	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	
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	

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。

11/2	6.9 期权的 VaR	讲课、讨论课	
12/1	7.1 资本的定义及作用	讲课、课堂互动	
	7.2 《巴塞尔协议》的前世今生		
	7.3 资本的分类和构成		
13/1	7.4 资本充足率监管	讲课、课堂互动	习题 3
	7.5 杠杆率：以风险为基础的		
13/2	8.1 传统信用风险管理	讲课、课堂互动	
	8.2 信用风险度量		
	8.3 度量违约风险的精算法		
14/1	8.4 度量违约风险的市场价格法	讲课、课堂互动	
	8.5 信用风险组合管理		
	8.6 交易对手风险管理		
15/1	8.4 度量违约风险的市场价格法	讲课、课堂互动	
	8.5 信用风险组合管理		
	8.6 交易对手风险管理		
15/2	9.1 操作风险定义	讲课、课堂互动	
	9.2 操作风险评估：损失分布法		
	9.3 操作风险的管理		
16/1	9.1 操作风险定义	讲课、课堂互动	
	9.2 操作风险评估：损失分布法		
	9.3 操作风险的管理		


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	期末考试	50%
X1	平时表现	10%
X2	小组作业	20%

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。

X3	小论文	20%
----	-----	-----

任课教师：梁艳

系主任审核： 2023. 2. 23