

课程教学进度计划表

一、基本信息

课程名称	金融风险管理				
课程代码	2060805	课程序号	7618, 7630	课程学分/学时	3/48
授课教师	卢峥	教师工号	19192	专/兼职	专
上课班级	金融工程 B22-1, 金融 工程 B22-2 及 B22-2 专升 本	班级人数	43, 44	上课教室	一教 412, 一 教 416, 12 号 楼 311, 三楼 405
答疑安排	周一上午 3、4 节/周四上午 1、2 节				
课程号/课程网站					
选用教材	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				
参考教材与资料	微观经济学 2060152(3)、 宏观经济学 2060070(3)、 高等数学(1)经管类 2130048 (5)、 高等数学(2)经管类 2130049 (4)				

二、课程教学进度安排

课次	课时	教学内容	教学方式	作业
1	3	风险与金融风险, 风险、损失与不确定性 风险管理的流程和方法 风险管理方法的演变	案例引导讲课	课后练习
2	3	金融机构的功能和分类 银行业的主要风险类型 评估风险管理过程	案例引导讲课	课后练习
3	3	刻画随机变量 随机变量: 均值、方差、偏度和峰度 正态分布和对数正态分布	案例引导讲课	课后练习
4	3	如何计算投资的回报: 收益率 如何计算投资的风险: 标准差	案例引导讲课	课后练习

5	3	单个风险证券投资 两个风险资产的投资组合 两个风险资产组合的有效边界	案例引导讲课	课后练习
6	3	多个风险资产构成的投资组合 为什么组合多元化 可以降低风险 无风险借贷与市场均衡 套利定价理论	案例引导讲课	课后练习
7	3	测度风险：一个历史视角 VaR 的定义 VaR 的计算：基于连续分布 VaR 的计算：基于离散分布 增量 VaR 与边际 VaR	案例引导讲课	课后练习
8	3	VaR与预期亏损 风险一致性度量 谱风险测度 VaR的参数选择	案例引导讲课	课后练习
9	3	定义波动率 时间的平方根法则 自相关性对 VaR 的影响	案例引导讲课	课后练习
10	3	风险的时间序列与 ARCH 模型 EWMA 模型和 GARCH (1,1) 模型	案例引导讲课	课后练习
11	3	金融衍生品的概念 市场参与者的类型 远期 期货 互换 期权	案例引导讲课	课后练习
12	3	管理线性风险：对冲 非线性风险管理：希腊值 期权的VaR	案例引导讲课	课后练习
13	3	资本的定义及作用 《巴塞尔协议》的前世今生 资本的分类和构成 资本充足率监管 杠杆率：以 风险为基础的	案例引导讲课	课后练习
14	3	传统信用风险管理 信用风险度量 度量违约风险 的精算法	案例引导讲课	课后练习
15	3	度量违约风险的市场价格法 信用风险组合管理 交易对手风险管理	案例引导讲课	课后练习
16	3	操作风险概述 操作风险度量 操作风险管理	案例引导讲课	课后练习

三、考核方式

总评构成	占比	考核方式
1	60%	闭卷考试
X1	20%	作业
X2	10%	课堂表现
X3	10%	考勤

任课教师:  (签名)

系主任审核:  (签名)

日期: 2025年1月18日