华中科技大学管理学院

硕士研究生课程教学日历

（资产评估专业硕士）

课程名称：风险管理 课程代码：300.755

主教教师：杨萍 电话： 18627769881

电子邮件：[yangping@mail.hust.edu.cn](mailto:yangping@mail.hust.edu.cn)

1. **课程概述**

风险管理就是研究风险发生规律并对其进行控制，采取必要的措施和方法，促使风险事件向有利的方向转化，使风险损失减少到最低程度。它也是一种机制，通过这种机制我们可以发现、评估主要的风险，然后制订、实施相应的对策，使风险被控制在企业所能接受的范围内。它使企业在风险最低的前提下，追求收益最大化；或在收益一定的前提下，追求风险最小化。其内容包括以下几个层次：1)风险的界定以及企业风险管理目标，其中包括风险的分类、企业风险管理的损前及损后目标；2)风险管理决策层，其中包括风险识别、风险评估、风险管理方法以及风险管理决策方法等；3)保险以及金融衍生工具在企业风险管理中的应用，其中重点讨论保险的基本原理、定价，以及金融衍生工具在企业风险管理中的具体运用等；4）风险管理在企业管理中的应用；5）企业的危机管理等该领域中的新趋势。

1. **教学目的**

通过本课程的学习，希望资产评估专业硕士的学生在风险管理上既具有全球视野，又要了解中国国情，能够针对中国实际及全球化运作对风险管理的内容有全面的了解，要求达到：（1）了解风险管理在企业经营中的重要性，把握风险管理与企业其它职能管理（财务、营销、人力资源等）之间的关系；（2）了解现代企业在风险管理上面临的新机遇和新挑战，熟悉风险管理的内容和方法体系；（3）结合不同类型企业的实际，学会运用风险管理的理论和方法分析解决实际问题。

1. **教学方法**

课堂讲解、案例分析与讨论、个人与小组书面报告等。

1. **课程参考资料**
2. 教材：《风险管理》，刘新立，北京大学出版社，2014
3. 参考书：《企业风险管理》，谢科范、袁明鹏，武汉理工大学出版社，2014
4. 参考书：《风险管理理论与工具》，范道津、陈伟珂，天津大学出版社，2012
5. 参考书：《风险管理》，王周伟，机械工业出版社，2012
6. 参考书：《风险管理》，许谨良，中国金融出版社，2011
7. 参考书：《风险管理与金融机构》，[美]赫尔著，王勇等译，机械工业出版社，2008
8. **考核方法**

课堂参与：10%； 专题讨论：10%； 课程作业：10%； 期末考试：70%

1. **教学日程安排（32学时/2学分）**

第1章 风险管理导论（4学时）

1.1确定性、不确定性与风险

1.2 风险的分类

1.3 风险管理概述

阅读：教材第1章

案例讨论

1. 风险识别 （4学时）

2.1风险识别的定义

2.2 风险识别方法

阅读：教材第2章

 案例讨论

第3章 风险评估（4学时）

3.1 风险分析

3.2 风险估计

3.3 风险评价

阅读：教材第5、6章

第4章 风险管理方法 （4学时）

4.1 风险控制

4.2 风险融资

4.3 风险管理方法综述

阅读：教材第3章，教材第8章

案例讨论

第5章 保险 （4学时）

5.1 可保风险与保险

5.2 保险的基本原则

5.3 保险费率

5.4 再保险

阅读：教材第9章

案例讨论

第6章 风险管理决策（4学时）

6.1 风险管理决策的数理基础

6.2 风险管理决策的方法

阅读：教材第10章

案例讨论

第7章 风险管理应用－企业风险管理（4学时）

7.1 全面风险管理的内涵

7.2 IRM的基本框架

7.3 跨国公司的风险管理策略

阅读：参考书5第11、12章

案例讨论

第8章 企业危机管理 （4学时）

8.1危机管理的定义

8.2 危机管理的过程

8.3企业危机管理的法则

阅读：参考书5第17、18章

案例讨论

备注：因授课内容和课时不变，具体上课日期依每学期课表而定。