

# 上海高校示范性全英语教学课程建设

## 项目申报表

学校名称（公章） 上海对外经贸大学

课程名称（中文） 商业银行风险管理

（英文） Risk Management of Commercial Banks

课程类别 专业基础课 专业课 基础课

课程对象（院系、专业） 金融银行本科专业

选用教材 Risk Management and Financial Institution

开设学期 第5学期

课程负责人 陈晓静

申报日期 2014年4月7日

上海市教育委员会 制

## 填写要求

- 一、 以 word 文档格式如实填写各项，空缺项要填“无”。
- 二、 表格文本中外文名词第一次出现时，要写清全称和缩写，再次出现时可以使用缩写。
- 三、 涉密内容不填写，有可能涉密和不宜大范围公开的内容，请在说明栏中注明。
- 四、 开设学期是指在教学计划中的开课学期。
- 五、 表格空间不足的，可以扩展或另附纸张；均用 A4 纸打印，于左侧装订成册。

## 1. 课程负责人情况

1-1 基本信息	姓名	陈晓静	性别	女	出生年月	1972. 08	
	最终学历	博士研究生	专业技术职务	教授	电话	13621980077	
	学位	博士	行政职务	无	传真	67703320	
	所在院系	金融管理学院		学科专业	金融学		
	通信地址	上海市松江区文翔路 1900 号					
		邮编	201620	E-mail	chenxjxj@126.com		
	研究方向	商业银行风险管理、国际金融					
1-2 教学情况	<p>近两年来授课、教学研究情况</p> <p><b>授课情况：</b></p> <p>近两年来一直承担《商业银行经营管理》、《商业银行风险管理》、《国际金融》全英语课程教学工作，一直用国际前沿的教学理念和教学内容灌输给学生，学生出勤率很高，教学效果良好，也一直耐心仔细回答学生教学、择业及生活中的困惑，学生评教分数在 4.65 分左右。</p> <p><b>教学研究情况：</b></p> <p>[1] 承担上海对外经贸大学研究生讲座课程建设项目《商业银行经营管理》一项，2014.03—2014.09.</p> <p>[2] 承担上海对外经贸大学商科案例开发项目《正泰电器有限公司融资模式》一项，2014.03—2014.09.</p>						
1-3 学术研究	<p>近两年来科研情况</p> <p>近两年来承担了多项风险管理领域的省部级课题、出版了相关领域专著和发表了四大检索论文，具体如下：</p> <p>[1] 《上海自贸区中资银行离岸业务研究》，上海市政府决策咨询课题，项目主持人，2013.11-2014.06, 在研.</p> <p>[2] 《上海离岸金融中心建设中的金融市场风险管理研究》，上海市政府决策咨询课题，编号：2011-Z-44-U，项目主持人，2012.06-2012.12, 已结题.</p> <p>[3] 《基于产业生态系统视角的股改后上海市银行业国际竞争力提升策略研究》，2009 年度上海市教育委员会科研创新重点项目，编号：09ZS187，项目主持人，2009.01-2011.12, 已结题.</p> <p>[4] 《新时期我国对外投资进程中的企业走出去战略及竞争力提升策略研究》，上海对外经贸大学 085 项目，编号：Z08511017，2012.01-2012.12, 已结题.</p> <p>[5] 陈晓静，股份制改造后上海市银行业国际竞争力提升策略研究——基于产业生态系统视角，经济管理出版社. 19.5 万字，2012.</p>						

	<p>[6] 陈晓静, 公司组织结构对隐性知识创新影响的实证研究, 复旦产业评论, 第 5 辑, 93-100 页, 2011.</p> <p>[7] 陈晓静, 李冠琦, 我国推出股指期货对股票市场波动性影响的实证研究, 国际商务研究, 第 2 期, 61-68, 2011.</p> <p>[8]Xiaojing Chen, Empirical Study on the Relationship between Tacit Knowledge Creation and the Evolution of Core Competence, IEEE 出版社, 317-321 页, 武汉, 2010. 12. 4-5, 大会报告 (EI:20113614307526).</p> <p>[9]Yingfei Zheng, Xiaojing Chen, A Research Review on Channels of Regulatory Related Factors Affecting Bank Risk-Taking Behaviors, The Fourth China Lixin Risk Management Forum, 299-304页, Shanghai, 2010. 10. 25, 大会报告.</p> <p>[10]Yingfei Zheng, Daoyuan Cao, Xiaojing Chen, Rough Set Based Competitiveness Evaluation on China's Automobile Industry, Proceedings of the 4th Conference on Systems Science, Management Science &amp; System Dynamics, 115-125 页, Shanghai, 2010. 12. 10-12, 大会报告.</p>																																
<p>1-4 英语 水平 及 英语 教学</p>	<p>国外学习经历; 英语教学经历 (含课程名称、学时数、学生数、开设时间) <b>国外学习和英语教学经历:</b></p> <p>[1] 2011.01-2012.02 美国杜克大学访学一年, 英语水平高, 能胜任国际会议英文翻译工作, 为杜克大学全球化研究中心开设讲座 <i>The Upgrading of International Competitiveness of Chinese Commercial Banks</i>.</p> <p>[2] 2008.09-2008.10 意大利 Modena 大学访学, 为本科生和研究生开设讲座 <i>The Upgrading of International Competitiveness of Chinese Commercial Banks</i>.</p> <p><b>国内英语教学经历如下, 已经承担四轮以上全英语教学。</b></p> <table border="1" data-bbox="323 1429 1393 1805"> <thead> <tr> <th>开设时间</th> <th>课程名称</th> <th>学时数</th> <th>学生数</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>2009.02-2009.06</td> <td>《商业银行风险管理》(英)</td> <td>36</td> <td>150</td> </tr> <tr> <td>2010.02-2010.06</td> <td>《商业银行风险管理》(英)</td> <td>36</td> <td>47</td> </tr> <tr> <td>2012.02-2012.06</td> <td>《商业银行风险管理》(英)</td> <td>36</td> <td>28</td> </tr> <tr> <td>2013.02-2013.06</td> <td>《商业银行风险管理》(英)</td> <td>36</td> <td>18</td> </tr> <tr> <td>2014.02-2014.06</td> <td>《商业银行风险管理》(英)</td> <td>36</td> <td>39</td> </tr> <tr> <td>2010.03</td> <td><i>The Development of Chinese Economy</i></td> <td>16</td> <td>欧洲商学院 MBA40</td> </tr> <tr> <td>2011.07</td> <td>Investment in Shanghai</td> <td>2</td> <td>留学生 60</td> </tr> </tbody> </table>	开设时间	课程名称	学时数	学生数	2009.02-2009.06	《商业银行风险管理》(英)	36	150	2010.02-2010.06	《商业银行风险管理》(英)	36	47	2012.02-2012.06	《商业银行风险管理》(英)	36	28	2013.02-2013.06	《商业银行风险管理》(英)	36	18	2014.02-2014.06	《商业银行风险管理》(英)	36	39	2010.03	<i>The Development of Chinese Economy</i>	16	欧洲商学院 MBA40	2011.07	Investment in Shanghai	2	留学生 60
开设时间	课程名称	学时数	学生数																														
2009.02-2009.06	《商业银行风险管理》(英)	36	150																														
2010.02-2010.06	《商业银行风险管理》(英)	36	47																														
2012.02-2012.06	《商业银行风险管理》(英)	36	28																														
2013.02-2013.06	《商业银行风险管理》(英)	36	18																														
2014.02-2014.06	《商业银行风险管理》(英)	36	39																														
2010.03	<i>The Development of Chinese Economy</i>	16	欧洲商学院 MBA40																														
2011.07	Investment in Shanghai	2	留学生 60																														
<p>1-5 获奖 情况</p>	<p><b>近两年教学、科研获奖情况</b></p> <p>近两年教学和科研尚无获奖, 但是多篇论文进入 EI 国际检索, 课题按期结题并鉴定为优秀或者良好。</p> <p>[1] 《新时期我国对外投资进程中的企业走出去战略及竞争力提升策略研</p>																																

	<p>究》，上海对外贸易学院 085 项目，编号：Z08511017，2012. 01-2012. 12，鉴定为优秀。</p> <p>[2]] 《公司核心竞争力形成过程中的组织学习方式研究》，国家自然科学基金项目，编号：70372014，项目第二负责人，负责研究问卷设计和实证研究，芮明杰教授为该项目主持人，2004. 01-2006. 12, 已结题，鉴定为良。</p> <p>[3]Xiaojing Chen, Mingjie Rui, Jie Zhang, Jingfei Wu, Empirical Study on the Influential Factor on Tacit Knowledge Creation within E-commerce Environment[J]. Journal of Computational Information Systems, 5(3):319-326, 2009. (EI:20092712162960)</p> <p>[4]Xiaojing Chen, Empirical Study on the Relationship between Tacit Knowledge Creation and the Evolution of Core Competence, IEEE 出版社, 317-321 页, 武汉, 2010. 12. 4-5, 大会报告 (EI:20113614307526)</p> <p>[5]Xiaojing Chen, Jingfei Wu, Organizational Learning during the Evolution of Core Competence: an Empirical Study of Corporations in China, 电子工业出版社, 138-142 页, 上海, 2009. 05, 大会报告 (ISTP: BMY02)</p> <p>[6]Chen Xiaojing, Rui Mingjie, The Influence of Organizational Learning Mode on Tacit Knowledge Creation: an Empirical Study of Corporations in China, IEEE 出版社, 1084-1089 页, 美国, 2008. 09. 10-12, 大会报告 (EI: 20085211805042; ISTP: BI025)</p>
--	---

## 2. 教学队伍情况

2-1 人员 构成 (含外 聘教师)	姓名	性别	出生年月	专业技术职务	学科专业	在教学中承担的工作
	李晓隽	女	1981. 02	讲师	金融学	案例编写
	郑迎飞	女	1977. 10	副教授	金融学	教学方案建设
	Gary Gereffi	男	1948. 07	教授	产业经济学	国际前沿讲座
	方艳	女	1975. 12	讲师	统计学	风险管理模型教学
2-2 主讲 教师 情况	<p>除课程负责人外的其他主讲教师情况简介（国外学习经历；近两年来授课、教学研究情况）</p> <p><b>2-2-1 Gary Gereffi 教授简介</b></p> <p>Gary Gereffi 是美国杜克大学全球化、公司治理、产业竞争力研究中心主任、教授, 富夸商学院兼职教授。他是全球价值链理论的提出者, 在全球价值链研究领域作出了突出的贡献。他的研究中心承担了世界银行、亚洲开发银行、美国洛克菲勒基金、英国产业发展基金等重要课题。他一直承担富夸商学院 MBA 教学工作, 教学深受学生好评。</p> <p><b>教学研究情况:</b></p> <p>[1]Gary Gereffi , Joonkoo Lee, Why the World Suddenly Cares About Global Supply Chains , Journal of Supply Chain Management, 2012, 48, 3: 24-32.</p> <p>[2]Stephanie Barrientos, Gary Gereffi , Arianna Rossi , Economic and Social Upgrading in Global Production Networks: A New Paradigm for a Changing World, International Labour Review , 2011, 150 (3-4): 319-340.</p> <p>[3]Gary Gereffi, Global Value Chains and International Competition, The Antitrust Bulletin, 2011, 56 (1): 37-56.</p> <p>[4]Stacey Frederick, Gary Gereffi, Upgrading and Restructuring in the Global Apparel Value Chain: Why China and Asia Are Outperforming Mexico and Central America, Special issue of International Journal of Technological Learning, Innovation and Development, 2011, 4 (1/2/3): 67-95.</p> <p>[5]Frederick Mayer, Gary Gereffi , Regulation and Economic Globalization: Prospects and Limits of Private Governance, Business and Politics, 第</p>					

2010, 3: 11-18.

#### 2-2-2 郑迎飞副教授简介

郑迎飞，上海对外经贸大学副教授，硕士生导师，2011.06-2012.06，美国波士顿大学管理学院访问学者。上海交通大学经济与金融学硕士、管理科学与工程博士，主要研究方向：产业组织理论与政策、金融机构管理、创新管理。曾赴加拿大 Douglas College 进修会计学，投资学和财务报表分析。目前主持教育部人文社会科学研究项目《三大类因素影响银行冒险行为的途径实证研究——基于政府规制视角》，2007-2009 年主持上海市教委科研创新项目《中国银行业的产业组织演化——基于实证和演化博弈的研究》和上海高校选拔培养优秀青年教师科研专项基金项目《全面开发条件下中国金融业的产业组织演化与风险管理》，曾参与多项国家自然科学基金项目和一项国家 863 课题研究工作，以第一作者身份发表了学术论文 20 余篇。主讲《国际金融》、《证券投资分析与组合管理》、《金融信托与租赁》等课程，教学效果良好。

#### 近两年授课：

- [1] 2012.09-2013.01 投资分析与组合管理（英）
- [2] 2013.02-2013.06 证券分析（外）
- [3] 2013.09-2014.01 投资分析与组合管理（英）
- [4] 2014.02-2014.06 证券分析（外）

#### 教学研究情况：

- [1] Zheng Yingfei , Zhang Shuxia , Chen Xiaojing , Liu, Fang, Application of Modified hapley Value in Gains Allocation of Closed-loop Supply Chain under Third-Party Reclaim, Energy Procedia, 第5期, 980-984页, 2011.
- [2] 郑迎飞, 外资并购的策略性动机均衡分析, 安徽大学学报: 哲学社会科学版, 第33卷, 第1期, 129-133页, 2009.
- [3] 郑迎飞, 陈宏民, “消灭式外资并购” 的市场条件识别, 管理工程学报, 第22卷, 第3期, 123-125页, 2008.
- [4] Yingfei Zheng, Xiaojing Chen, A Research Review on Channels of Regulatory Related Factors Affecting Bank Risk-Taking Behaviors, The Fourth China Lixin Risk Management Forum, 299-304 页, Shanghai, 2010.10.25.
- [5] Yingfei Zheng, Daoyuan Cao, Xiaojing Chen, Rough Set Based Competitiveness valuation on China's Automobile Industry,

Proceedings of the 4th Conference on Systems Science, Management Science & System Dynamics, 115-125页, Shanghai, 2010.12.10-12.

### 2-2-3 方艳简介

方艳获得美国俄勒冈州立大学博士学位, 2008.03-2012.05, 俄勒冈州立大学统计学博士。美国统计学会会员, 系统学过统计方法、一般回归模型、Time Series and Spatial Statistics、统计学模拟、高级实验设计、贝叶斯统计、应用多元分析、采样方法、非参数化和半参数化方法、Microarray Data Analysis、高级统计理论、实分析和高级概率论。2012.12至今, 上海对外经贸大学金融管理学院讲师, 从事《金融统计分析》课程教学。

#### 近两年授课:

2013.02-2013.06 金融数学

2013.09-2014.01 金融时间序列分析

2014.02-2014.06 金融数学

#### 教学研究情况:

[1] L. Madsen, Y. Fang\*, Joint regression analysis for discrete longitudinal data, Journal of the international biometric society, 第67卷, 第3期, 1171-1175页, 2011

### 2-2-4 李晓隽简介

李晓隽获得英国伯明翰大学金融学博士学位, 在英国学习多年(2005.2009.12), 于2010.09来到上海对外经贸大学金融管理学院工作, 一直承担《商业银行风险管理》(英)的教学工作, 教学效果良好。

#### 近两年授课:

2012.09-2013.02 商业银行风险管理(英)

2013.09-2014.02 商业银行风险管理(英)



### 3. 课程描述

#### 3-1 本课程教学理念与目标

##### 教学理念:

学生的课程学习体验来自于对课程教学活动的参与和投入，是教师教学与学生学习互动的结果。努力增加教师与学生之间的交流，会让学生在—门课程的学习过程中受益更多。大量研究表明，主动学习与合作学习是本科教育中有效教学的重要途径。这些活动的设计与实施有利于调动学生学习积极性，促使其全身心投入，在不断探索思考中学会运用所学知识解决新的问题。

“商业银行风险管理”课程设置的目的是为了培养学生全面系统掌握商业银行风险管理的基本理论、基本方法和基本技巧，提高学生在商业银行各种风险管理环境中思维敏捷、决策果断、应对灵活的能力，以更好地适应经济全球化和我国入世背景下全面对外开放的银行业管理工作的需要。全英文教学活动的开展，在采用国外原版优质教材和配套资源的同时吸收和借鉴国外同类课程教学理念、经验和方法，通过教师讲授、课堂讨论、案例分析和讨论、金融管理人士讲座、项目作业等多种教学模式的综合运用，充分鼓励学生采用合作方式主动学习，提高学生学习兴趣、丰富学生的学习体验。

##### 教学目标:

为帮助学生获得本门的课程修读的认知能力，根据布鲁姆等人提出的教育认知分类法，将教学目标围绕着知识、运用、分析、综合和判断五个方面设计如下：

- (1) 认识和理解商业银行风险管理的核心思想、理论体系，掌握各种风险管理基本方法；
- (2) 具备在国际金融环境中从事风险分析和风险管理的专业知识和外语沟通能力。
- (3) 分析商业银行风险管理宏观环境、识别商业银行各种风险、提出解决方案、构建风险管理模型和提出风险管理措施。

#### 3-2 教学内容选择与安排

一学期 18 周时间，主要完成 8 章内容的讲解。一章内容分四课时完成，期间还补充课外案例讲解和讨论，主要教学内容如下：

周次	教 学 内 容
1	Chapter 1 Introduction
2	Chapter 1 Introduction
3	Chapter 2 Financial products and how they are used for

	hedging
4	Chapter 2 Financial products and how they are used for hedging
5	Chapter 3 How traders manage their exposures
6	Chapter 3 How traders manage their exposures
7	Chapter 4 Interest rate risk
8	Chapter 4 Interest rate risk
9	Chapter 7 Bank regulation and Basel II
10	Chapter 7 Bank regulation and Basel II
11	Mid Exam
12	Chapter 8 The VaR measure
13	Chapter 8 The VaR measure
14	Chapter 11 Credit risk: estimating default probabilities
15	Chapter 11 Credit risk: estimating default probabilities
16	Case Study
17	Revision
18	Final Exam
19	

**3-3 教学方法、手段（举例说明采用的各种教学方法及手段的使用目的、实施过程、实施效果）**

**本课程的培养目标：**坚持专业学习与培养能力相结合、业务能力培养与人才素质教育相结合，力求帮助学生奠定扎实的功底，同时不断增强学生分析和解决实际问题的能力，培养符合当代社会需要的既懂专业又有较高英语水平的高素质应用型人才。

**本课程的教学改革目标定位为：**在教学中融入实践探索，重点通过案例教学引导和发展学生的分析思维能力；通过双语教学提高学生金融英语的应用能力，培养学生具有较强的对外英语沟通的能力；通过网络平台、实践教学、专家讲座等方式将教学延伸到课外，最大限度地调动起学生自主学习的主动性和积极性，力争多方面、多层次地培养符合市场需求的应用型金融人才，构建以培养应用型金融人才为核心、体现金融专业特色、适应可持续发展的金融人才培养模式。

为此，课程组教师积极开展教学改革，采用多种**教学手段与方法**，不断提高教学质量

和人才培养效果，具体包括：

**(1) 英语教学：** 教学过程中，坚持渐进性、互动性原则，通过案例引出专业术语和专业知识，培养学生主动用英语表达的习惯。根据学生实际情况，对学生进行分组，将教学任务布置到小组，让学生们在小组内或小组间进行专业英语练习。另外，还应用实景模拟方法，结合案例或让学生通过角色扮演理解专业词汇和名词解释，培养学生用英语表达专业知识的能力。

**(2) 案例教学：** 在全英语教学伊始，课程就实施案例教学。首先，向学生介绍案例教学的基本知识；其次，选择相应案例，引导学生运用已学理论知识，组织学生小组及班级讨论，从而找出问题，提出解决问题的多个互斥的可行性方案。

**(3) 网络辅助教学：** 课程组重视构建网络教学平台，不断丰富和优化教学手段。为充分利用宝贵的课堂教学时间，在教学中引入现代教育技术手段的基础上，课程组将课堂学习与网络辅助教学相结合，把教案、阅读参考资料、最新专业资讯等上传到网络教学平台供学生课外自习，并在讨论板上挂出问题，供同学们研究探讨，取得了一定成果。

**(4) 模拟软件教学：** 建立金融模拟实验室，学生们可进行商业银行风险管理各环节的模拟，使学习和实践的场景更加逼真、更接近现实。这一现代化的教学手段和方法激发了学生的学习兴趣，收到良好的教学效果。

**(5) 启发式教学：** 在教学中有目的地运用启发式教学手段，主要有三种：①课前设置问题，即事先提出问题，引导学生先行思考，自己尝试解答。这样便于让学生带着问题学习，提高学习效果。课前设置的问题特点是选择现实中常见的问题，一般为学生所关心，急于了解，因而易激发学生学习兴趣。②课中提问，对知识难点，引导学生思考和让学生自己给出答案，然后老师进行肯定或纠正，使学生对知识重点和难点的理解印象深刻，有利于学生掌握所学知识。③课后总结，沟通每部分知识要点和内在联系，启发学生对理论的思考系统深入发展。

**(6) 自主学习：** 教学中探索和实践自主学习的教学模式，在课堂教学中穿插 8 课时的课堂实训、4 课时的上机，由教师布置任务，提高学生的学习兴趣。

**(7) 校企联合教学：** 结合银行对人才需求情况以及学校、课程的实际情况，对“培养方案+学校学习+专家讲座+银行参观实践——校企联合”的教学方法进行了探讨，在

一定程度上提高了学生的综合素质以及认识问题和解决问题的实际能力。

**(8) 互动式教学：**教学中我们充分发挥学生的主动性、参与性和创造性，强化学生之间、师生之间的多维互动，完成“自学、导学、助学和促学”相互联系的教学过程。课堂授课中，师生角色由主导型向伙伴型转换，充分调动学生探求知识的积极性和主动性，如采取案例研讨、情境模拟等多元化的教学方式，增进师生间的互动。课堂外，借助课程网络教学平台、电子邮件、电话、博客等媒介，通过在线测试、预习复习等多维的课外教学方式，补充和延续师生间的交互。

### 3-4 考核（考试）方法

分平时测验和期末考试多种考核方法，各占一定的比例，以闭卷考试为主，开卷考试为辅的方法。

项目	比例
课堂出勤	10%
平时作业	10%
平时测验	10%
期中考试	10%
期末考试	60%
试卷题型	单选、计算题、简答、论述及案例讨论等

### 3-5 教材（含英语教材使用与建设；扩充性英语资料使用情况）

#### 英语教材使用与建设：

[1] John C. Hull, Risk Management and Financial Institutions, Person International Edition, 2010.

[2] Anthony Saunders, Financial Institutions Management: A Risk Approach, McGRAW-HILL International Edition, 2010.

[3] 各类期刊杂志来源于 Journal of Banking and Finance, Journal of Derivatives, Journal of Financial Economics, Journal of Finance 等等。

[4] 各种相关的教学案例来源于 Ivey 商学院和各大上市银行网站。

#### 扩充性英语资料使用情况：

为打破教材一本书的单一格局（内容比较简单，更新相对较慢，且篇幅有限，始终无法反映最新内容和包括全部的资料），为发挥多种教学资源的配合、互补、协调作用，

更为了向同学们的自学提供广阔的空间，实现全方位、立体化、多视角的课程教学新模式，课程组注重加强教学扩充性资料的建设，以帮助学生更好地进行自主学习。课程组在每次课前或课后将相关参考文件、最新的风险管理方法以及一些优秀的国内外商业银行各类风险管理案例印成讲义或者挂在教学平台上供学生学习、思考。

### 3-6 网络资源（含网络硬件环境，网上资源名称列表、网址链接及在教学中的使用情况）

**网络硬件环境：**使用学校校园网提供的硬件环境。上海对外经贸大学网络硬件环境不错，有丰富的网络资源，如 Springer LINK, EBSCO 电子书, BVD 金融数据库系列, 剑桥期刊回溯库, PQDT 博硕士论文, 世界银行免费数据库, CALIS 西文期刊目录次数据库, Elsevier Science Direct Online, Econlit 经济学全文数据库, JSTOR 过刊数据库。

#### **网上资源名称列表：**

- [1] 课程介绍：教学内容、教学安排、教材及参考资料、考核要求等。
- [2] 教师队伍：授课教师简介，授课教师办公时间、地点及联系方式。
- [3] 课程资料库：教学大纲、教案、教学课件、讨论案例、思考题等。
- [4] 练习题：包括课程习题集、案例集及学生自测模拟试卷等。
- [5] 知识扩展区：国内外精品公开课程推荐、跨国公司及中国企业国际营销案例、经典文献推荐、国内外营销研究机构、学会及组织的外部链接。
- [6] 交流与讨论：网络交流与讨论

### 3-7 教学效果（学生评教指标和校内管理部门提供的近两年的学生评价分数及评语；课程负责人教学录像要点）

#### **学生评教指标有以下十方面：**

#### **评教指标**

- (1) 课程目的明确，课程内容有价值、信息量大
- (2) 教师备课认真充分，按照教学方案的要求与进度开展教学活动
- (3) 对课程内容娴熟，讲课重点突出，思路清晰，有启发性
- (4) 讲课语言生动、流畅、标准，有感染力，能吸引学生注意力
- (5) 教学方法灵活多样，能激发学生的学习兴趣
- (6) 教学手段得当，使用多媒体教学有效果

- (7) 教师与学生积极交流，鼓励学生提出问题
- (8) 教师不随意缺课、调课、停课和减少课时
- (9) 教师布置并批改作业，有课后答疑
- (10) 通过学习，学生思维能力得到提高，能有效掌握课程内容

**校内管理部门教务处提供的近两年的学生评价分数及评语：（满分为 5 分）**

开课学期	课程名称	任课教师	学生人数	总分
2012. 02-2012. 07	商业银行风险管理（英）	陈晓静	28	4. 537
2013. 02-2013. 07	商业银行风险管理（英）	陈晓静	18	4. 67
2013. 09-2014. 01	国际金融（英）	陈晓静	110	4. 639
2012. 02-2012. 07	投资分析与组合管理（英）	郑迎飞	90	4. 547
2013. 02-2013. 07	证券分析	郑迎飞	65	4. 2925
2013. 09-2014. 01	投资分析与组合管理（英）	郑迎飞	87	4. 785
2012. 09-2013. 01	商业银行风险管理（英）	李晓隽	26	4. 802
2013. 09-2014. 01	商业银行风险管理（英）	李晓隽	21	4. 8443
2013. 02-2013. 06	金融数学	方艳	75	4. 5403
2013. 09-2014. 01	金融时间序列分析	方艳	68	4. 908

**学生评价：**

**学生 1：** 教学内容丰富，能够理论联系实际，教学风格深入浅出，风趣易懂。教学节奏与任务难度相适应。教学课程中穿插作业和小组讨论，大家集思广益地完成学习思考，十分有意义；

**学生 2：** 课程内容很丰富，涉及面很广，实用性较强；任课老师都很负责；

**学生 3：** 本课程对银行专业的学生来说，是一门非常实用的课。让我和同学们非常印

象深刻的是老师们的教学，老师风格迥异，却各有千秋。譬如：方艳老师年轻有活力，且非常平易近人。陈晓静老师认真严谨，和蔼可亲，有一种大家之风，且陈老师的专业知识十分丰富，基本上传授的都是国内外前沿的知识，常常令我们觉得受益匪浅。

课程负责人教学录像要点：

**Video Topic: Interest Rate Risk**

时间安排	授课要点	讲解内容
前 10 分钟： 导入主题	商业银行利率风险的含 义及风险管理	从商业银行破产案和金融风险衍生品在实践中的应用引导学生认识商业银行利率风险和风险管理的重要性。
中间 32 分 钟：主题互动 讨论	复利、零期利率、远 期利率、久期的概念以 及在实践中的应用	将复利计算的公式运用于公司债券价格和收益的定价，在讲解中理论联系实践，尽量将复杂的公式深入浅出，使学生充分理解，学生课堂热烈讨论；讨论了远期利率的计算；介绍了 LIBOR 和掉期利率的互换；最后引入久期的计算，详细讲解了久期计算公式的构成成分和应用。
后 3 分钟： 课后学习安 排	总结课堂所学 内容	布置课后作业和阅读书目。

**4. 课程建设规划**

4-1 本课程四年内的建设规划（含课程网站建设规划）

**总体目标：**努力将《商业银行风险管理》（双语）建成国家级双语教学精品课程。

围绕上述目标，本课程**四年内的建设规划**主要包括：

- **2014. 06-2015. 05** 到银行调研和专家访谈，调研国内外商业银行风险管理模型，参加国内相关教学研讨会一次，完成第一期风险管理案例库建设，邀请国外专家讲座一次，召开全英语教学研讨会一次；完成部分课程网站建设；完成网站商业银行风险管理案例库建设，发表教学论文一篇；鼓励并创造条件支持课程组教师参加国家相关部门或有关机构举办的业务培训，进一步提高师资队伍业务水平和实际工作能力；

鼓励并创造条件支持课程组教师开展产学研实践和研究。

- 2015. 06-2016. 05 完成第一期商业银行风险管理课件建设和部分教学录像；  
完成部分课程网站建设和商业银行风险管理课件建设，师资国内培训一次；  
鼓励并创造条件支持课程组教师赴国外大学学习交流，不断提高双语教学水平；  
积极创造条件邀请国际优秀师资共同参与课程建设与教学活动，不断提高课程建设水平。
- 2016. 06-2017. 05 完成第二期商业银行风险管理案例库建设和风险管理试题库建设，完成所有教学录像，邀请国外专家讲座一次，召开全英语研讨会一次；  
完成所有课程网站建设和网上课外阅读文献建设；  
发表论文一篇；  
大力建设网络教学平台，实现传统课堂讲授与远程自主学习的有机结合，充分利用网络调研、在线测试、案例库、网络讨论、外部链接等功能模块；  
积极鼓励学生进行课程的网络自主学习，形成有效的互动学习氛围。
- 2017. 06-2018. 05 完成所有教学课件建设，完成所有教学实践设计；  
完成课程网站所有内容建设；  
发表全英语教学论文一篇。

#### 4-2 聘请国外教师（专家）来华授课计划

- ◆ 建设期第一年，即 2015 年 5 月中旬，邀请美国杜克大学教授 Gary Gereffi 来华《商业银行风险管理》前沿讲座一次；授课 2 次，主要讲解国际前沿的风险管理经验和方法，尤其是金融衍生品在风险管理中的应用。
- ◆ 建设期第三年，即 2017 年 5 月中旬，邀请美国杜克大学教授 Gary Gereffi 来华《商业银行风险管理》前沿讲座一次；授课 2 次，主要讲解国际前沿的风险管理经验和方法，尤其是美国 Wells Fargo 银行的利率风险管理经验和方法。



#### 4-3 学校鼓励全英语教学课程建设的政策措施及实施情况

我校作为华东唯一的对外经贸大学，一直以来十分重视全英语教学，对外合作办学开展较早、合作办学项目向多层次高水平方向发展。学校在制度保障、建设经费管理、教学环境、师资培训等方面对全英语教学课程建设提供了诸多政策支持。

政策措施	实施效果
<b>师资培训计划</b>	<p>学校重视对双语课程教师的师资培养，优先提供境外交流和访问的机会，提高授课课时费，鼓励教师投入精力进行双语教学研究。</p> <p>学校长期鼓励并资助教师海外学习和交流。自 1995 年中外合作办学以来，我校已派 100 多人次海外进修培训，经过培训的老师都已成为双语教学的骨干力量。</p> <p>邀请加拿大 Ivey 商学院资深教授来我校对教师进行案例教学和写作培训，该培训已举办五期，效果良好。派教师到 Ivey 香港分院观摩 Ivey 教师的授课，反响良好。2007 年起不定期派教师到 Ivey 加拿大进修案例教学法。</p>
<b>双语及案例教学研究计划</b>	<p>学校对双语教学课程在课程建设上优先立项，具体办法按《上海对外贸易学院学科、专业和课程建设管理办法》规定实。</p> <p>2005 年在外贸经济教育高地项目中专门设立案例教学和双语教学研究中心。该中心每年举办一次案例教学和双语教学研讨会，开展教师间双语教学和双语案例教学研究交流。</p>
<b>英文教材、学术期刊，以及教学资料的采购计划</b>	<p>学校根据先进性、学术性和适用性原则，选择最新出版的外语原版教材，既符合教学大纲要求，又要求充分考虑学生的学科基础水平与外语接受能力。每年在订购图书和学术期刊时均征求教师建议，满足教师对英文教材、图书、学术期刊的订阅要求。我校每年向 Ivey 商学院购买六十个案例使用权，以丰富教学内容。</p>
<b>制定双语教学课程暂行管理规定</b>	<p>2006 年制定的“上海对外贸易学院双语教学课程暂行管理规定”明确了“双语教学”和“全外语教学”的区别和认定依据，并在现行课时津贴的基础上全外语教学课程津贴提高 80%，双语教学津贴提高 50%。我校教务处对全英文教</p>

学采取评审制，对课件、试卷等均实行制度化管理，注重双语课程和全英文语课程的校内自查工作，督促教师及时补充、更新课程内容。

在学校课程建设中，双语教学课程被列为重点建设课程，因此学校优先安排双语教学教师出国学习。在教师岗位聘任考核中，在同等条件下优先聘任承担双语教学任务的教师。

学校对英语授课课程建设的投入力度大，对课程建设有长期科学的规划。如商业银行风险管理课程，即从 2009 年起，依次经过校级双语课程建设、有步骤地从中文向双语再向全英文课程建设的方向努力。

学校大力宣传全英文课程的建设成果，通过校园网等媒介，积极向师生宣传双语课程的建设成果，并在学生选课前明确标注双语或英语课程名称及开设学期，在扩大课程影响的同时，提高其共享水平。这些对商业银行风险管理全英语课程的设立与开展创造了良好的条件。

## 5. 学校意见

### 5-1 课程负责人

本人承诺：表中所填内容均真实有效。

签字：

日期：2014 年 4 月 17 日

### 5-2 教务处意见

本课程符合申报条件，申报材料已于        年        月        日至        年  
月        日在学校网站上公示。

负责人签字（盖章）：

日 期：

### 5-3 学校意见

主管校长签字（盖章）：

日 期：