

淡江大學 100 學年度第 2 學期課程教學計畫表

| | | | |
|---|--|----------|----------------------|
| 課程名稱 | 保險公司資產負債管理實務 | 授課 教師 | 田峻吉 TIEN, JYUN-JI |
| | PRACTICE ON ASSET LIABILITY MANAGEMENT FOR INSURANCE COMPANY | | |
| 開課系級 | 保險四 P | 開課 資料 | 選修 單學期 3學分 |
| | TBIXB4P | | |
| 系 (所) 教育目標 | | | |
| <p>一、充實保險專業知識，提升學生專業技能。</p> <p>二、重視產學合作互動，結合理論與實務運用。</p> <p>三、鼓勵專業證照考試，提升學生就業競爭能力。</p> | | | |
| 系 (所) 核心能力 | | | |
| <p>A. 具有一般商學專業知識之能力。</p> <p>B. 具有辨識保險商品之能力。</p> <p>C. 具有核保理賠及行銷之能力。</p> <p>D. 具有保險理財規劃之能力。</p> <p>E. 具有風險管理與保險經營管理之能力。</p> <p>F. 具有職業倫理及團隊合作精神。</p> | | | |
| 課程簡介 | <p>本課程幫助學生了解保險公司如何進行資產負債管理，課程內容包含保險法、資本適足性、34公報、國際會計準則、準備金提存。希望修習此課程後，學生更加熟悉保險業的運作模式。</p> | | |
| | <p>The purpose of this course provide students concepts related to how insurance companies manage their asset and liability go through several important topics of ALM. Such as insurance law, RBC, IFRS, reserve, etc. Wish students understand more detail in operating asset and liability of insurance business.</p> | | |

本課程教學目標與目標層級、系(所)核心能力相關性

一、目標層級(選填)：

- (一)「認知」(Cognitive 簡稱C)領域：C1 記憶、C2 瞭解、C3 應用、C4 分析、C5 評鑑、C6 創造
- (二)「技能」(Psychomotor 簡稱P)領域：P1 模仿、P2 機械反應、P3 獨立操作、P4 聯結操作、P5 自動化、P6 創作
- (三)「情意」(Affective 簡稱A)領域：A1 接受、A2 反應、A3 重視、A4 組織、A5 內化、A6 實踐

二、教學目標與「目標層級」、「系(所)核心能力」之相關性：

- (一)請先將課程教學目標分別對應前述之「認知」、「技能」與「情意」的各目標層級，惟單項教學目標僅能對應C、P、A其中一項。
- (二)若對應「目標層級」有1~6之多項時，僅填列最高層級即可(例如：認知「目標層級」對應為C3、C5、C6項時，只需填列C6即可，技能與情意目標層級亦同)。
- (三)再依據所訂各項教學目標分別對應其「系(所)核心能力」。單項教學目標若對應「系(所)核心能力」有多項時，則可填列多項「系(所)核心能力」。(例如：「系(所)核心能力」可對應A、AD、BEF時，則均填列。)

| 序號 | 教學目標(中文) | 教學目標(英文) | 相關性 | |
|----|-----------------------|--|------|----------|
| | | | 目標層級 | 系(所)核心能力 |
| 1 | 使學生了解保險業資產面及負債面結構。 | To illustrate the asset and liability structure of insurance industry. | C3 | AE |
| 2 | 使學生了解保險資產負債管理在實務上的應用。 | To explain the application of ALM in practice. | A6 | AE |

教學目標之教學方法與評量方法

| 序號 | 教學目標 | 教學方法 | 評量方法 |
|----|-----------------------|------------|--------------|
| 1 | 使學生了解保險業資產面及負債面結構。 | 講述、討論、問題解決 | 紙筆測驗、報告、上課表現 |
| 2 | 使學生了解保險資產負債管理在實務上的應用。 | 講述、討論、問題解決 | 紙筆測驗、報告、上課表現 |
| | | | |

本課程之設計與教學已融入本校校級基本素養與核心能力

| 淡江大學校級基本素養與核心能力 | 內涵說明 |
|-----------------|--|
| ◇ 表達能力與人際溝通 | 有效運用中、外文進行表達，能發揮合作精神，與他人共同和諧生活、工作及相處。 |
| ◇ 科技應用與資訊處理 | 正確、安全、有效運用資訊科技，並能蒐集、分析、統整與運用資訊。 |
| ◇ 洞察未來與永續發展 | 能前瞻社會、科技、經濟、環境、政治等發展的未來，發展與實踐永續經營環境的規劃或行動。 |
| ◇ 學習文化與理解國際 | 具備因應多元化生活的文化素養，面對國際問題和機會，能有效適應和回應的全球意識與素養。 |
| ◆ 自我了解與主動學習 | 充分了解自我，管理自我的學習，積極發展自我多元的興趣和能力，培養終身學習的價值觀。 |
| ◇ 主動探索與問題解決 | 主動觀察和發掘、分析問題、蒐集資料，能運用所學不畏挫折，以有效解決問題。 |
| ◆ 團隊合作與公民實踐 | 具備同情心、正義感，積極關懷社會，參與民主運作，能規劃與組織活動，履行公民責任。 |
| ◆ 專業發展與職涯規劃 | 掌握職場變遷所需之專業基礎知能，管理個人職涯的職業倫理、心智、體能和性向。 |

授課進度表

| 週次 | 日期起訖 | 內容 (Subject/Topics) | 備註 |
|----|-------------------------|-------------------------------|----|
| 1 | 101/02/13~ 101/02/19 | 課程介紹 | |
| 2 | 101/02/20~ 101/02/26 | 保險公司財務報表 | |
| 3 | 101/02/27~ 101/03/04 | 保險法第146條 | |
| 4 | 101/03/05~ 101/03/11 | 保險公司資產：有價證券、抵押貸款、不動產、流動資產(現金) | |
| 5 | 101/03/12~ 101/03/18 | 人壽保險公司資產管理 | |
| 6 | 101/03/19~ 101/03/25 | 產物保險公司資產管理 | |
| 7 | 101/03/26~ 101/04/01 | 準備金提存 | |
| 8 | 101/04/02~ 101/04/08 | 保險公司利源分析 | |
| 9 | 101/04/09~ 101/04/15 | 會計準則第34號公報 | |
| 10 | 101/04/16~ 101/04/22 | 期中考試週 | |
| 11 | 101/04/23~ 101/04/29 | IFRS 4(國際會計準則第四號) | |
| 12 | 101/04/30~ 101/05/06 | 資本適足性 (Risk-Based Capital) | |

| | | | |
|--------------|---|----------------|--|
| 13 | 101/05/07~ 101/05/13 | 風險衡量值 (VaR) | |
| 14 | 101/05/14~ 101/05/20 | 未來保險公司面臨的風險與挑戰 | |
| 15 | 101/05/21~ 101/05/27 | 畢業考試週 | |
| 16 | 101/05/28~ 101/06/03 | --- | |
| 17 | 101/06/04~ 101/06/10 | --- | |
| 18 | 101/06/11~ 101/06/17 | --- | |
| 修課應 注意事項 | 包含一篇分組報告 | | |
| 教學設備 | 電腦、投影機 | | |
| 教材課本 | Lecture notes are arranged by professor | | |
| 參考書籍 | | | |
| 批改作業 篇數 | 篇 (本欄位僅適用於所授課程需批改作業之課程教師填寫) | | |
| 學期成績 計算方式 | ◆出席率： % ◆平時評量：30.0 % ◆期中評量：30.0 % ◆期末評量：25.0 % ◆其他〈出席成績〉：15.0 % | | |
| 備 考 | 「教學計畫表管理系統」網址： http://info.ais.tku.edu.tw/csp 或由教務處 首頁〈網址： http://www.acad.tku.edu.tw/index.asp/ 〉教務資訊「教學計畫 表管理系統」進入。 ※不法影印是違法的行為。請使用正版教科書，勿不法影印他人著作，以免觸法。 | | |