

淡江大學 99 學年度第 1 學期課程教學計畫表

課程名稱	保險公司資產負債管理研究	授課 教師	田峻吉 Tien, Jyun-ji
	ADVANCE STUDY ON ASSET LIABILITY MANAGEMENT FOR INSURANCE CO		
開課系級	保險一碩士班 A	開課 資料	選修 單學期 3學分
	TBIXM1A		
學 系(門) 教 育 目 標			
一、重視保險專題研究，深化保險專業知識。 二、加強研究分析能力，提升研究論文品質。 三、強化產學合作互動，結合理論與實務。			
學 生 基 本 能 力			
A. 具備保險商品設計之能力。 B. 具備分析及解決問題之能力。 C. 具備表?及簡報之能力。 D. 具備獨立研究之能力。 E. 具備保險財務管理之能力。 F. 具備國際觀之視野。 G. 具備團隊合作之精神。			
課程簡介	本課程幫助碩士班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。此外，本課程將帶領學生閱讀與資產負債管理相關的保險論文，期望學生能將理論融會貫通應用於實務中，提升我國保險專業水平。		
	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 the graduated students understand more detail in operating asset and liability of insurance business. Furthermore, it's necessary conditional to read papers related to ALM of JRI, Geneva Review. Wish the students can apply the theoretical theory to the practice in order to enhance the professional knowledge of insurance industry in Taiwan.		

本課程教學目標與目標層級、學生基本能力相關性

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」、「學生基本能力」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該系「學生基本能力」。單項教學目標若對應「學生基本能力」有多項時，則可填列多項「學生基本能力」(例如：「學生基本能力」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	學生基本能力
1	使學生了解保險業資產面及負債面結構。使學生了解保險資產負債管理在實務上的應用。閱讀保險資產負債相關文獻，將理論實務結合。	To illustrate the asset and liability structure of insurance industry.To explain the application of ALM in practice.To apply theory for practice by reading literature related to ALM.	C6	ABCDEFGF

教學目標之教學策略與評量方法

序號	教學目標	教學策略	評量方法
1	使學生了解保險業資產面及負債面結構。使學生了解保險資產負債管理在實務上的應用。閱讀保險資產負債相關文獻，將理論實務結合。	課堂講授、分組討論	出席率、報告、討論、期末考

授課進度表

週次	日期	內容 (Subject/Topics)	備註
1	09/13	Introduction	
2	09/20	The Financial Statement in Retail Industry	
3	09/27	Insurance Law Section 146	
4	10/04	Asset Management for Life Insurance Industry	
5	10/11	Asset Management for Property-Liability Insurance Industry	
6	10/18	Reserve Management for Life Insurance Industry	

7	10/25	Reserve Management for Property-Liability Insurance Industry	
8	11/01	Accounting Principle 34	
9	11/08	International Financial Report Standard (IFRS 4)	
10	11/15	Insurance Regulation: RBC	
11	11/22	The Practice Report (1)	
12	11/29	The Practice Report (2)	
13	12/06	The Practice Report (3)	
14	12/13	The Academic Report (1)	
15	12/20	The Academic Report (2)	
16	12/27	The Academic Report (3)	
17	01/03	New Inspirations for ALM of Insurance Industry	
18	01/10	Final Examination	課程進度會依照實際授課情況及修課人數作調整
修課應注意事項		本課程注重上台報告，分為實務報告及理論報告。實務報告主題與台灣保險業所面臨的風險為主，理論報告老師會挑選JRI, IME或是Geneva Review與資產負債管理相關的文章閱讀	
教學設備		電腦、投影機	
教材課本		Lecture notes are arranged by professor TBA (To be appointed)	
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		◆平時考成績： % ◆期中考成績： % ◆期末考成績：30.0 % ◆作業成績： 60.0 % ◆其他〈出席成績〉：10.0 %	
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。 ※非法影印是違法的行為。請使用正版教科書，勿非法影印他人著作，以免觸法。	