

## 東吳大學遠距教學課程教學計畫

### 壹、課程基本資料

(1)課程名稱	中文	資產負債管理 (課號：MBM80502)	
	英文	ASSET AND LIABILITY MANAGEMENT	
(2)開課系級	<p>財精碩二</p> <p style="color: red;">請務必註明學年級，如為一、二年級之專業必修課(重補修課程不受此限)，請於此欄提供必須開設為遠距課程之相關說明。</p> <p>本課程為財務工程與精算數學研究所 (財務工程組與精算數學組) 的碩二必修課程，由於本課程為總結性課程 (亦為 EMI 課程)，需要由實務領域的專家共同授課，裨益碩二研究生瞭解如何將理論知識與實務工作進行有效銜接。惟本課程業師遴聘極為不易 (需同時兼備實務專業能力與英語授課能力)，且要求授課時段為週間時段 (同時亦為實務界的工作時間)。對此，本課程必須採用遠距非同步的方式進行，始有利於實務專業教師的邀請與聘任。</p>		
(3)開課單位名稱	財務工程與精算數學系		
(4)授課教師姓名及職稱	李宜熹 (LEE, YI-HSI) / 專任副教授 林聖倫 (LIN, SHENG-LUN) / 兼任助理教授級專業技術人員 <span style="color: red;">如為共同授課，授權書應由主持人確認後代為簽署</span>		
(5)師資來源	<input checked="" type="checkbox"/> 專業系所聘任 <input type="checkbox"/> 通識中心聘任 <input type="checkbox"/> 以上合聘 <input type="checkbox"/> 其他		
(6)開課資料	<input checked="" type="checkbox"/> 必修 <input type="checkbox"/> 選修	<input type="checkbox"/> 第一學期 <input checked="" type="checkbox"/> 第二學期 <input type="checkbox"/> 暑期重補修 <input type="checkbox"/> 暑期提前開課 <span style="color: red;">不同開課學期，請分開填寫教學計畫表</span>	_____ 學分 2
(7)教學型態	<input type="checkbox"/> 線上同步 <input type="checkbox"/> 線上同步+線上非同步 <input type="checkbox"/> 線上同步+面授 <input checked="" type="checkbox"/> 線上非同步+面授 <input type="checkbox"/> 線上同步+線上非同步+面授		
(8)課程學制	<input type="checkbox"/> 學士班 <input type="checkbox"/> 進修學士班 <input checked="" type="checkbox"/> 碩士班 <input type="checkbox"/> 碩士班 <input type="checkbox"/> 博士班 <input type="checkbox"/> 學位學程(含學士、碩士班、碩士在職專班) <input type="checkbox"/> 學分學程(含教育學程)		
(9)科目類別	<input type="checkbox"/> 共同科目 <input checked="" type="checkbox"/> 專業科目 <input type="checkbox"/> 教育科目 <input type="checkbox"/> 通識科目 <input type="checkbox"/> 其他(含全校性選修)		

表九之一 113 學年度適用

(10)預計總修課人數	15
(11)全英語教學	<input checked="" type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 否
(12)跨校／跨國遠距課程	<input type="checkbox"/> 是：合作學校與系所名稱 <input type="checkbox"/> 主 播 <input type="checkbox"/> 收 播 <input type="checkbox"/> 境 外 專 班 <input type="checkbox"/> 雙 聯 學 制 <input type="checkbox"/> 其 他 <input checked="" type="checkbox"/> 否

貳、課程教學計畫

一、教學目標	中文	本課程將以財務管理方法、風險評估技術及監理規範為主軸，並透過台灣與美國金融業之實際案例，分析在資產負債管理層面的問題與可能的解決方案。本課程預期學生能延伸對於一般財務管理理論與方法的瞭解，並進一步認識金融業所面對之特定風險與資產配置等課題。課程主題包含：金融機構之風險、市場風險、利率風險、信用風險、資產配置策略、資本制度與監理規範等。			
	英文	In this course, the lecturer will introduce the financial management methods, risk assessment methods, supervisory norms for financial industry and analyze the potential problems and solutions in ALM through real cases in Taiwan and USA. Students are expected to extend the knowledge learned from general financial management theory and to understand the specific risks and practical issues faced by financial industry. The main contents cover risks of financial institutions, market risk, interest rate risk, credit risk, asset allocation strategy, capital system, and regulations.			
二、修讀對象	財精碩二學生(財務工程組與精算數學組) 請詳述修讀對象之條件，如：建議先修科目、先備條件與能力等。				
三、課程內容大綱與教學進度	週次	課程內容 1.應清楚明確，使學生能確實掌握各週學習目標。 2.每週必填，共 18 週；畢業班為 14 週(請自行調整)。 3.遠距教學課程授課時數包含課程講授(影音教材)、師生互動討論、線上測驗、作業同儕互評等互動方式。	授課方式 1.網路遠距之時數應達總時數之 1/2 2.同步教學或教室面授至少 6 週以上 3.請填寫每週上課時數		
			線上遠距		教室面授
	範例	(1)課程內容、成績計算、授課方式說明 (2)1-1「遠距課程實施」、1-2「遠距課程線上互動」	同步	非同步	
	1	Course Introduction (LEE, YI-HSI)			2
	2	Asset Liability Management Theory Overview I (LEE, YI-HSI)		2	
3	Asset Liability Management Theory Overview II (LEE, YI-HSI)		2		

表九之一 113 學年度適用

	4	Interest Rate Risk Measurement Theory (LEE, YI-HSI)		2	
	5	Interest Rate Risk Measurement Practice in the Insurance Industry (LIN, SHENG-LUN)		2	
	6	Market Risk Measurement Theory			2
	7	Market Risk Measurement Practice in the Insurance Industry (LIN, SHENG-LUN)		2	
	8	Asset Liability Management Practice in the Insurance Industry (LIN, SHENG-LUN)		2	
	9	Midterm Report (LEE, YI-HSI)			2
	10	Risk Mitigation Management – Futures and Options (LIN, SHENG-LUN)		2	
	11	Risk Mitigation Management – Hedging Strategy (LIN, SHENG-LUN)		2	
	12	Paper Study I - Asset Liability Management Techniques and Practices for Insurance Companies (LEE, YI-HSI)			2
	13	Paper Study II- Asset Liability Management Techniques and Practices for Insurance Companies (LEE, YI-HSI)			2
	14	Paper Study III- Asset Liability Management Techniques and Practices for Insurance Companies (LIN, SHENG-LUN)		2	
	15	Foreign Exchange Hedging Practice I in the Insurance Industry (LEE, YI-HSI)		2	
	16	Foreign Exchange Hedging Practice II in the Insurance Industry (LEE, YI-HSI) 線上/實體期末課堂反應問卷施測		2	
	17	Final Report (LEE, YI-HSI)			2
	18	Strategic Insights and Reflections in Asset and Liability Management (LEE, YI-HSI) 此週雖為彈性補充教學，但總學期上課週數仍維持 18/14 週，教師應透過教學活動安排，提供學生多元學習或自主學習			2
	備註	教師每週會額外提供課輔時間，每週固定約談不同 1/4 的同學進行線上同步或實體討論，此時段亦開放給當週非固定約談同學預約一起討論，以利有效掌握學生的學習成效。 如有連續 4 週以上均採非同步線上方式授課，請於此欄補充說明如何掌握學生學習成效之相關措施。			
四、 教學方式 (可複選)	本欄填寫方式請務必與上表一致 <input type="checkbox"/> 提供 同步教學，次數：_____次，總時數：_____小時 <input checked="" type="checkbox"/> 提供 非同步教學，次數：11次，總時數：22小時 <input checked="" type="checkbox"/> 提供 面授教學，次數：7次，總時數：14小時				

表九之一 113 學年度適用

	<p><input type="checkbox"/>無須安排學校教室 (須<b>全數為線上教學</b>課程方可勾選)</p> <p><input type="checkbox"/>其他，請說明：</p>
五、 課程預計使用的 學習管理系統功 能	<p><b>教學平台(教材放置、課堂反應問卷設定平台，請擇一使用)</b></p> <p>■本校 TronClass 行動化數位學習平台</p> <p><input type="checkbox"/>本校 Moodle 數位學習平台</p> <p><b>同步視訊使用軟體(有線上同步教學之課程必填)</b></p> <p>■Microsoft Teams <input type="checkbox"/>Google Meet</p> <p><input type="checkbox"/>其他：請填寫軟體名稱，並說明使用原因</p> <p><b>課程內容 (可複選)</b></p> <p>■課程簡介 ■課程安排 ■教材目錄 ■測驗/考試 ■作業/報告</p> <p><input type="checkbox"/>其他，請說明：</p> <p><b>課程資訊 (可複選)</b></p> <p>■最新消息 ■課程公告 ■評量方式 ■教師、助理資訊</p> <p><input type="checkbox"/>常見問題 <input type="checkbox"/>成績資訊 ■提供教材內容供學習者下載</p> <p>■線上討論區<input type="checkbox"/>線上作業繳交 <input type="checkbox"/>其他，請說明：</p> <p><b>教學活動(至少使用 5 種)</b></p> <p>■教師講述 ■操作演示 ■議題討論 ■實作練習 <input type="checkbox"/>角色扮演</p> <p>■分組報告 ■同儕互評 <input type="checkbox"/>腦力激盪 <input type="checkbox"/>搶答 <input type="checkbox"/>辯論</p> <p><input type="checkbox"/>其他，請說明：</p>
六、 師生互動討論	<p>教師線上固定討論時段(必備，每兩週 1 小時)：<u>每週課前或課後固定時段的 30 分鐘 (第一週與同學商定)</u></p> <p>教師實體空間課輔時間：<u>視排課結果決定課輔時間 (每週 1 小時)</u></p> <p><input type="checkbox"/>無研究室之兼任教師，請與學生討論後，另約時間地點討論</p> <p>教師 E-mail 信箱及分機：<a href="mailto:eclee@scu.edu.tw">eclee@scu.edu.tw</a> / 2630</p> <p>其他，請說明：</p> <p><b>(註：相關互動資訊請務必留存備查)</b></p>
七、 評量方式 (可複選)	<p>■期中考試：30% (報告形式)</p> <p>■期末考試：30%(報告形式)</p> <p>■平時作業：20%</p> <p><input type="checkbox"/>線上小考：__%</p> <p>■出席出勤：10%</p> <p>■線上互動：10%(務必納入成績評量方式)</p> <p><input type="checkbox"/>其他 (請說明：_____ )：__%</p>
八、 修課注意事項	<p>建議先修科目：財務管理、統計學、壽險數學</p>
九、 教材及參考資料	<p>教師自編投影片與補充教材</p>

附註：遠距教學課程經教務會議核定後，教師需自行於校務行政系統上傳授課計畫。