

課程名稱：金融產業管理-理論與實務

Spring 2024
Department of Finance
National Taiwan University
Course Number: 723U1450

Instructor: 廖咸興

Sponser Entity: 國泰人壽

Office: Room 814, Building 2, College of Management

Phone: 33661090

Class hours: Wed. 14:20pm – 17:20 pm

Class Room: TBA

TA: 方思涵

Email: hliao@ntu.edu.tw

Office hours: by appointment

Course Materials:

1. Handouts

修課資格要求:

1. 限財金系及研究所學生
2. 學士班限四年級以上(含輔系、雙修生)
3. 需修過投資學者
4. 修課人數上限50人。

Course Objective:

課程內容包含財務投資、精算財工、風險管理三大模組。透過具有豐富實務經驗的來賓講師授課，並搭配企業參訪以及 Bloomberg 參訪，來讓修課同學更了解第一線實務狀況，以利同學整合理論與實務。

Grading Policy:

1. The course grades will be based on the following elements:

Mid-term Report

(評審主管評分包含70%簡報內容+QA問答10%+組內互評20%) 30%

Final Report

(評審主管評分包含70%簡報內容+QA問答10%+組內互評20%) 40%

Participation*

30%

*. 除了上課發言內容外，成績計算還包含企業「參訪」出席、Bloomberg參訪出席、以及每次來賓演講的授課當天下課後繳交當天筆記的評分。

2. There is no make-up exam in this course unless you encounter extraordinary situations.

Course Schedule:

113年 台灣大學X國泰人壽「金融產業管理：理論與實務課程」					
週	日期	課程構面	主題	部門單位	內容
1	2024/2/21	--	教授課程介紹	--	請教授提供課程助教窗口，以利課程相關聯繫
2	2024/2/28	--	和平紀念日放假	--	
3	2024/3/6	財投精算	台灣壽險市場概況	昭廷執副	1.台灣壽險市場概況 2.壽險業面臨之挑戰及因應方式 3.總結
			壽險投資實務	宜芳副總	1.金融市場環境變遷與趨勢 2.壽險業投資策略決定 3.壽險業投資思維/壽險業資金運用
4	2024/3/13	財務投資	股票投資：bottom-up/ 產業分析	證一+證二	1.台股布局與國內證券實務&研究員日常 2.中國股市簡介
5	2024/3/20	財務投資	另類投資/專案	專投	1.公共建設與實務投資(太陽能、風電) 2.另類投資(私募基金)
6	2024/3/27	財務投資	股票投資：top down+計量	證二+投交	1.美投投資實務 2.計量投資理論與實務
7	2024/4/3	財務投資	企業參訪	證券協助聯繫	
8	2024/4/10	期中考周	期中報告	股票授課主管	
9	2024/4/17	財務投資	總經+債券及外匯市場實務	固三+固一+外匯	1.利率(影響公債利率因素)、央行、公債交易(利率方向實務判斷) 2.外匯波動影響與管理實務(外匯介紹、避險架構、壽險限制挑戰) 3.中國債市
10	2024/4/24	財務投資	固定收益投資	固二+固三	1.MBS與證券化商品 2.公司債概況及投資思維 3.新興債券市場概況及投資思維
11	2024/5/1	--	勞動節放假	--	
12	2024/5/8	財務投資	Bloomberg參訪	固收協助聯繫	Bloomberg常用功能介紹 1.總體經濟面：著重於基本面分析之功能使用 2.外匯交易實務常用功能簡介 3.信用產品分析：單一公司信用分析 4.新興市場分析：國家風險差異分析
13	2024/5/15	財投/風管	ESG責任投資+壽險業之風險管理	責投+風管	1.ESG責任投資 2.壽險業經營環境/ 風險管理實務-國壽經驗分享/壽險業未來經營風險
14	2024/5/22	精算財工	商品經營實務(傳統型&投資型)	商品/投商部	1.台灣保險商品銷售狀況 2.商品獲利與風險淺談 3.商品經營與開發實務
15	2024/5/29	精算財工	IFRS17會計制度接軌策略	精算	IFRS 17與 ICS 簡介與保險業因應策略
16	2024/6/5	期末考周	期末報告	出題主管	題目待討論(建議財務投資模組1題、精算財工模組1題)