

淡江大學 100 學年度第 1 學期課程教學計畫表

課程名稱	債券市場與投資	授課 教師	洪瑞成 Hung,Jui-cheng
	BOND MARKET AND INVESTMENTS		
開課系級	財金四 A	開課 資料	必修 單學期 2學分
	TBBXB4A		
系 所 教 育 目 標			
配合本校、院教育目標，因應國內外金融情勢的演變，培養財務金融理論與實務兼具的財務金融人才。			
系 所 核 心 能 力			
A. 具備財務金融理論與實務的基本知識。 B. 加強相關金融法規的學習。 C. 培養財務金融職場的基本倫理與道德。 D. 提升學生的國際觀與外語能力。 E. 提升學生專業證照之能力。 F. 具備分析國內外金融發展情勢之基本能力。			
課程簡介	本課程在於提供分析債券市場的基本工具與知識。內容包含債券發行與債券評價、利率風險衡量、利率期間結構、債券投報率、債券交易、信用風險衡量、債券操作策略與債券創新設計等單元。		
	This course is designed to provide the fundamental tools that are commonly used for analysis in the bond markets. Issues covered in this course include Bond Pricing and Return Measuring, Bond Price Volatility, Term Structure of Interest Rate, Treasury and Agency Securities Markets, Corporate Debt Instruments and Municipal Securities, Global Bond Markets, Mortgage Pass-Through Securities and Collateralized Mortgage Obligations, Stripped Mortgage-Backed and Asset-Backed Securities, Analysis of Bonds with Embedded Options, and convertible bonds.		

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該系「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	1.介紹債券市場2.債券評價3.債券工具4.債券衡量及評價5.投資組合6.債券評等	1. Introduction to Bond Market, 2. Pricing of Bonds, 3. Bond Instruments, 4. Analysis of Bonds, 5. Bond Performance Measurement and Evaluation 6. Bond Portfolio Management, 7. Bond Rating.	C2	AE

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	1.介紹債券市場2.債券評價3.債券工具4.債券衡量及評價5.投資組合6.債券評等	課堂講授	出席率、小考、期中考、期末考

本課程之設計與教學已融入下列本校基本素養與核心能力

淡江大學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	100/09/05~ 100/09/11	債券市場介紹	
2	100/09/12~ 100/09/18	債券發行與債券評價	
3	100/09/19~ 100/09/25	債券發行與債券評價	
4	100/09/26~ 100/10/02	利率風險衡量	
5	100/10/03~ 100/10/09	利率期間結構	
6	100/10/10~ 100/10/16	債券投資報酬率、風險值及利率趨勢分析	
7	100/10/17~ 100/10/23	債券投資報酬率、風險值及利率趨勢分析	
8	100/10/24~ 100/10/30	債券交易	
9	100/10/31~ 100/11/06	期中考試週	
10	100/11/07~ 100/11/13	信用風險衡量	
11	100/11/14~ 100/11/20	信用風險衡量	
12	100/11/21~ 100/11/27	債券操作策略	

13	100/11/28~ 100/12/04	債券操作策略	
14	100/12/05~ 100/12/11	債券創新設計	
15	100/12/12~ 100/12/18	利率衍生商品	
16	100/12/19~ 100/12/25	可轉換公司債	
17	100/12/26~ 101/01/01	資產證券化商品	
18	101/01/02~ 101/01/08	期末考試週	
修課應 注意事項	學生應確實遵守學校上課規定		
教學設備	電腦、投影機		
教材課本	債券市場概論（薛立言、劉亞秋）華泰文化		
參考書籍	債券市場理論與實務（簡忠陵 著）証券暨期貨市場發展基金會		
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：20.0 % ◆期中考成績：30.0 % ◆期末考成績：30.0 % ◆作業成績： % ◆其他〈出席〉：20.0 %		
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。		