

淡江大學 109 學年度第 1 學期課程教學計畫表

| | | | |
|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------|----------------------|
| 課程名稱 | 固定收益證券 | 授課 教師 | 顧廣平 KU KUANG-PING |
| | FIXED INCOME SECURITIES | | |
| 開課系級 | 財金三 B | 開課 資料 | 實體課程 必修 單學期 2 學分 |
| | TLBXB3B | | |
| 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。 | | | |
| 本課程對應院、系(所)核心能力之項目與比重 | | | |
| A. 具備財務金融理論與實務的基本知識。(比重：80.00) E. 提升學生專業證照之能力。(比重：20.00) | | | |
| 本課程對應校級基本素養之項目與比重 | | | |
| 2. 資訊運用。(比重：20.00) 4. 品德倫理。(比重：20.00) 5. 獨立思考。(比重：60.00) | | | |
| 課程簡介 | 本課程的目的是希望能涵蓋債券工具、債券評價與面對利率變動時，債券價值衡量的分析技巧，以及達成客戶目標之投資組合策略。 | | |
| | The objective of this course is to provide coverage of the products, analytical techniques for valuing bonds and quantifying their exposure to changes in interest rates, and portfolio strategies for satisfying a client's needs. | | |
| 本課程教學目標與認知、情意、技能目標之對應 | | | |
| 將課程教學目標分別對應「認知 (Cognitive)」、「情意 (Affective)」與「技能 (Psychomotor)」的各目標類型。 | | | |
| 一、認知 (Cognitive)：著重在該科目的事實、概念、程序、後設認知等各類知識之學習。 二、情意 (Affective)：著重在該科目的興趣、倫理、態度、信念、價值觀等之學習。 三、技能 (Psychomotor)：著重在該科目的肢體動作或技術操作之學習。 | | | |
| 序號 | 教學目標(中文) | 教學目標(英文) | |
| | | | |

| | | |
|---|-----------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1 | 介紹債券價格的分析架構和投資特性 | The basic analytical framework necessary to understand the pricing of bonds and their investment characteristics. |
| 2 | 描述各個債券市場 | The various sectors of the debt market are described. |
| 3 | 介紹債券的評價方法 | Methodologies for valuing bonds are explained. |
| 4 | 介紹債券投資組合策略 | Bond portfolio strategies are discussed. |
| 5 | 介紹如何使用各種金融工具以控制投資組合風險 | The various instruments that can be used to control portfolio risk are explained. |

教學目標之目標類型、核心能力、基本素養教學方法與評量方式

| 序號 | 目標類型 | 院、系(所) 核心能力 | 校級 基本素養 | 教學方法 | 評量方式 |
|----|------|----------------|------------|------|------|
| 1 | 認知 | AE | 245 | 講述 | 測驗 |
| 2 | 認知 | AE | 245 | 講述 | 測驗 |
| 3 | 技能 | AE | 245 | 講述 | 測驗 |
| 4 | 認知 | AE | 245 | 講述 | 測驗 |
| 5 | 認知 | AE | 245 | 講述 | 測驗 |

授課進度表

| 週次 | 日期起訖 | 內容 (Subject/Topics) | 備註 |
|----|-------------------------|---------------------------|----|
| 1 | 109/09/14~ 109/09/20 | 課程簡介與債券發行 | |
| 2 | 109/09/21~ 109/09/27 | 債券評價 | |
| 3 | 109/09/28~ 109/10/04 | 利率風險衡量 (I) | |
| 4 | 109/10/05~ 109/10/11 | 利率風險衡量 (II) | |
| 5 | 109/10/12~ 109/10/18 | 國慶日放假 | |
| 6 | 109/10/19~ 109/10/25 | 利率期限結構 (I) | |
| 7 | 109/10/26~ 109/11/01 | 利率期限結構 (II) | |
| 8 | 109/11/02~ 109/11/08 | 債券投資報酬, 風險值, 及利率趨勢分析 (I) | |
| 9 | 109/11/09~ 109/11/15 | 債券投資報酬, 風險值, 及利率趨勢分析 (II) | |
| 10 | 109/11/16~ 109/11/22 | 期中考試週 | |
| 11 | 109/11/23~ 109/11/29 | 債券交易 | |
| 12 | 109/11/30~ 109/12/06 | 信用風險衡量 | |

| | | | |
|--------------|-------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--|
| 13 | 109/12/07~ 109/12/13 | 債券操作策略 (I) | |
| 14 | 109/12/14~ 109/12/20 | 債券操作策略 (II) | |
| 15 | 109/12/21~ 109/12/27 | 債券創新設計 | |
| 16 | 109/12/28~ 110/01/03 | 利率衍生商品(I) | |
| 17 | 110/01/04~ 110/01/10 | 利率衍生商品(II) | |
| 18 | 110/01/11~ 110/01/17 | 期末考試週 | |
| 修課應 注意事項 | | | |
| 教學設備 | | 電腦、投影機 | |
| 教科書與 教材 | | 薛立言, 劉亞秋 (2018) “債券市場概論”, 四版, 華泰書局 | |
| 參考文獻 | | | |
| 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： 10.0 % ◆平時評量： % ◆期中評量：45.0 % ◆期末評量：45.0 % ◆其他〈 〉： % | |
| 備考 | | 「教學計畫表管理系統」網址： https://info.ais.tku.edu.tw/csp 或由教務處 首頁→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。 | |