

淡江大學 1 1 1 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	陳淑娟 CHEN SHU CHUAN
	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		
課程與SDGs 關聯性	SDG1 消除貧窮 SDG8 尊嚴就業與經濟發展 SDG9 產業創新與基礎設施 SDG11 永續城市與社區		
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：30.00) B. 加強相關金融法規的學習。(比重：15.00) C. 培養財務金融職場的基本倫理與道德。(比重：5.00) D. 提升學生的國際觀與外語能力。(比重：10.00) E. 提升學生專業證照之能力。(比重：30.00) F. 具備分析國內外金融發展情勢之基本能力。(比重：10.00)			
本課程對應校級基本素養之項目與比重			
1. 全球視野。(比重：10.00) 2. 資訊運用。(比重：10.00) 3. 洞悉未來。(比重：5.00) 4. 品德倫理。(比重：10.00) 5. 獨立思考。(比重：30.00) 6. 樂活健康。(比重：5.00) 7. 團隊合作。(比重：20.00) 8. 美學涵養。(比重：10.00)			
課程簡介	此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	1 說明基本債券價格的分析架構和投資特性 2 闡述各個債券市場 3 介紹債券的評價方法 4 概要債券投資組合策略 5 描述如何使用各種金融工具以控制投資組合風險	1The basic analytical framework necessary to understand the pricing of bonds and their investment characteristics. 2The various sectors of the debt market are described. 3Methodologies for valuing bonds are explained. 4Bond portfolio strategies are discussed. 5The 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	ABCDEF	12345678	講述、討論	測驗、作業、報告(含口頭、書面)

授課進度表

週次	日期起訖	內 容 (Subject/Topics)	備註
1	111/09/05~ 111/09/11	課程簡述與債券發行	
2	111/09/12~ 111/09/18	債券評價	
3	111/09/19~ 111/09/25	利率風險衡量	
4	111/09/26~ 111/10/02	利率期限結構 (I)	
5	111/10/03~ 111/10/09	利率期限結構 (II)	
6	111/10/10~ 111/10/16	債券投資報酬, 風險值, 及利率趨勢分析 (I)	
7	111/10/17~ 111/10/23	債券投資報酬, 風險值, 及利率趨勢分析 (II)	
8	111/10/24~ 111/10/30	利率趨勢研判	

9	111/10/31~ 111/11/06	債券交易	
10	111/11/07~ 111/11/13	期中考試週	
11	111/11/14~ 111/11/20	信用風險衡量	
12	111/11/21~ 111/11/27	債券操作策略 (I)	
13	111/11/28~ 111/12/04	債券操作策略 (II)	
14	111/12/05~ 111/12/11	債券創新設計	
15	111/12/12~ 111/12/18	利率衍生性金融商品	
16	111/12/19~ 111/12/25	可轉換公司債	
17	111/12/26~ 112/01/01	資產證券化商品	
18	112/01/02~ 112/01/08	期末考試週(本學期期末考試日期為:112/1/3-112/1/9)	
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： 30.0 % ◆平時評量： % ◆期中評量：35.0 % ◆期末評量：35.0 % ◆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。	