

淡江大學 114 學年度第 1 學期課程教學計畫表

|   |  |          |                     |
|---|--|----------|---------------------|
| 課程名稱  | 固定收益證券專題   | 授課<br>教師 | 林允永<br>LIN YUN-YUNG |
|   | SPECIAL TOPICS ON FIXED INCOME<br>SECURITIES               |          |                     |
| 開課系級  | 財金一碩專班 A   | 開課<br>資料 | 實體課程<br>選修 單學期 3學分  |
|   | TLBXJ1A  |          |                     |
| 課程與SDGs<br>關聯性  | SDG1 消除貧窮<br>SDG4 優質教育<br>SDG8 尊嚴就業與經濟發展                   |          |                     |
| 系（所）教育目標  |  |          |                     |
| 提供財務金融產業人才之專業訓練課程，以落實實務與理論融合應用之能力。  |  |          |                     |
| 本課程對應院、系(所)核心能力之項目與比重   |  |          |                     |
| A. 具備理論與實務融合應用之能力。(比重：30.00)<br>B. 具備個案研究與分析的能力。(比重：10.00)<br>C. 培養具備企業財務決策與分析之能力。(比重：15.00)<br>D. 發展專業競爭的能力與態度。(比重：10.00)<br>E. 提升財金研究理論與方法之素養。(比重：20.00)<br>F. 提升考取高階財金專業證照之能力。(比重：15.00) |  |          |                     |
| 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)<br>2. 資訊運用。(比重：10.00)<br>3. 洞悉未來。(比重：10.00)<br>4. 品德倫理。(比重：20.00)<br>5. 獨立思考。(比重：30.00)<br>6. 樂活健康。(比重：5.00)<br>7. 團隊合作。(比重：10.00)<br>8. 美學涵養。(比重：5.00)                  |  |          |                     |
| 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 |

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)<br>核心能力 | 校級<br>基本素養 | 教學方法  | 評量方式          |
|----|------|----------------|------------|-------|---------------|
| 1  | 認知   | ABCDEF         | 12345678   | 講述、討論 | 測驗、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  | 114/09/15~<br>114/09/21 | 概論                   |    |
| 2  | 114/09/22~<br>114/09/28 | 債券評價                 |    |
| 3  | 114/09/29~<br>114/10/05 | 報酬率衡量                |    |
| 4  | 114/10/06~<br>114/10/12 | 利率風險                 |    |
| 5  | 114/10/13~<br>114/10/19 | 利率期限結構               |    |
| 6  | 114/10/20~<br>114/10/26 | 債券投資報酬率，風險值及利率趨勢分析   |    |
| 7  | 114/10/27~<br>114/11/02 | 債券交易                 |    |
| 8  | 114/11/03~<br>114/11/09 | 期中報告                 |    |
| 9  | 114/11/10~<br>114/11/16 | 債券操作策略               |    |
| 10 | 114/11/17~<br>114/11/23 | 債券創新設計               |    |
| 11 | 114/11/24~<br>114/11/30 | 利率衍生商品               |    |

|              |                         |  |  |
|--------------|-------------------------|--|--|
| 12           | 114/12/01~<br>114/12/07 | 利率衍生商品   |  |
| 13           | 114/12/08~<br>114/12/14 | 可轉換公司債   |  |
| 14           | 114/12/15~<br>114/12/21 | 資產債券化商品  |  |
| 15           | 114/12/22~<br>114/12/28 | 期末報告   |  |
| 16           | 114/12/29~<br>115/01/04 | 期末報告   |  |
| 17           | 115/01/05~<br>115/01/11 | 自主學習   |  |
| 18           | 115/01/12~<br>115/01/18 | 自主學習   |  |
| 課程培養<br>關鍵能力 |                         | 問題解決   |  |
| 跨領域課程        |                         |  |  |
| 特色教學<br>課程   |                         |  |  |
| 課程<br>教授內容   |                         | 邏輯思考   |  |
| 修課應<br>注意事項  |                         | 生成式AI倫理聲明 本課程依據透明和負責任的原則，鼓勵學生利用AI進行協作和互學，以提升課程成果。 本課程採取以下措施： 有條件開放，請註明學生如何使用生成式AI於課程成果中。 學生應在課堂作業或報告中的「標題頁註腳」或「引用文獻後」簡要說明他們3 4 如何使用生成式AI（，例如進行議題發想、文潤飾或或結參見考等。如果經查核發現使用生成式AI但未在作業或報告中標明，教師、學校或相關單位有權重新評分或不予計分。 此外，本課程的授課教材或學習資料如有引用生成式AI內容，教師也會在投影片或口頭標註。修讀本課程的學生在選課時視為同意以上倫理聲明。 |  |
| 教科書與<br>教材   |                         | 採用他人教材:教科書、講義<br>教材說明：<br>薛立言：債券市場概論 4版  |  |
| 參考文獻         |                         |  |  |
| 學期成績<br>計算方式 |                         | ◆出席率：            %    ◆平時評量：            %    ◆期中評量：50.0 %<br>◆期末評量：50.0 %<br>◆其他〈 〉：            %  |  |
|              |                         |  |  |

|     |   |
|-----|---|
| 備 考 | <p>「教學計畫表管理系統」網址：<a href="https://web2.ais.tku.edu.tw/csp">https://web2.ais.tku.edu.tw/csp</a> 或由教務處首頁→教務資訊「教學計畫表管理系統」進入。</p> <p>※「遵守智慧財產權觀念」及「不得非法影印、下載及散布」。請使用正版教科書，勿非法影印他人著作，以免觸法。</p> |
|-----|---|