

淡江大學 99 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	顧廣平 Ku Kuang-ping
	BOND MARKET AND INVESTMENTS		
開課系級	財金四 B	開課 資料	必修 單學期 2學分
	TBBXB4B		
學系(門)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。			
學生基本能力			
<p>A. 具備財務金融理論與實務的基本知識。</p> <p>B. 加強相關金融法規的學習。</p> <p>C. 培養財務金融職場的基本倫理與道德。</p> <p>D. 提升學生的國際觀與外語能力。</p> <p>E. 提升學生專業證照之能力。</p> <p>F. 具有國際化、資訊化、未來化之願景規劃基本能力。</p> <p>G. 具備審視國內外金融發展情勢之基本能力。</p> <p>H. 培訓學生獨立、因應及解決問題的基本能力。</p>			
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		

本課程教學目標與目標層級、學生基本能力相關性

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」、「學生基本能力」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「學生基本能力」。單項教學目標若對應「學生基本能力」有多項時，則可填列多項「學生基本能力」(例如：「學生基本能力」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	學生基本能力
1	1. 介紹債券價格的分析架構和投資特性	1. the basic analytical framework necessary to understand the pricing of bonds and their investment characteristics.	C3	AEH
2	2. 描述各個債券市場	2. the various sectors of the debt market are described.	C2	AEG
3	3. 介紹債券的評價方法	3. methodologies for valuing bonds are explained.	P3	AEH
4	4. 介紹債券投資組合策略	4. bond portfolio strategies are discussed.	C4	AEH
5	5. 介紹如何使用各種金融工具以控制投資組合風險	5. the various instruments that can be used to control portfolio risk are explained.	C4	AEH

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. 介紹債券價格的分析架構和投資特性	課堂講授	出席率、期中考、期末考
2	2. 描述各個債券市場	課堂講授	出席率、期中考、期末考
3	3. 介紹債券的評價方法	課堂講授	出席率、期中考、期末考
4	4. 介紹債券投資組合策略	課堂講授	出席率、期中考、期末考
5	5. 介紹如何使用各種金融工具以控制投資組合風險	課堂講授	出席率、期中考、期末考

授 課 進 度 表

週次	日期	內 容 (Subject/Topics)	備註
1	09/13	債券發行	
2	09/20	債券評價 (I)	
3	09/27	債券評價 (II)	
4	10/04	利率風險衡量 (I)	
5	10/11	利率風險衡量 (II)	
6	10/18	利率期限結構 (I)	
7	10/25	利率期限結構 (II)	
8	11/01	債券投資報酬, 風險值, 及利率趨勢分析	
9	11/08	債券交易	
10	11/15	期中考試週	
11	11/22	信用風險衡量	
12	11/29	債券操作策略 (I)	
13	12/06	債券操作策略 (II)	
14	12/13	債券創新設計	
15	12/20	利率衍生商品	
16	12/27	可轉換公司債	
17	01/03	資產證券化商品	
18	01/10	期末考試週	

修課應
注意事項

教學設備

電腦、投影機

教材課本

薛立言, 劉亞秋 (2009) “債券市場概論”, 二版, 華泰書局

參考書籍

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：10.0 % ◆期中考成績：45.0 % ◆期末考成績：45.0 % ◆作業成績： % ◆其他〈 〉： %
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。