

103-2 大葉大學 完整版課綱

基本資料

| | | | |
|-------------|---------------------|----------|---------------|
| 課程名稱 | 固定收益證券 | 科目序號/代號 | 1381 /FBM3032 |
| 必選修/學分數 | 選修 /3 | 上課時段/地點 | (四)678 /B201 |
| 授課語言別 | 中文 | 成績型態 | 數字 |
| 任課教師 / 專兼任別 | 吳勝景 / 專任 | 畢業班/非畢業班 | 非畢業班 |
| 學制/系所/年班 | 大學日間部 /財務金融學系 /2年1班 | | |

課程簡介與目標

本課程透過介紹市場相關實務操作,教授債券和利率衍生性商品工具,使用最新模式來評價此類型的債券、量化利率風險的方法及使用投資組合的策略等,建立學生債券投資的決策。

課程大綱

本課程將分別介紹債券市場概況、債券特性、債券的投資風險與金融創新,內容如下:債券價格、債券殖利率的衡量、債券價格之波動性、債券殖利率及利率期間結構的因素、公司之債務工具、全球債券市場、貸款、抵押貸款轉手證券、附擔保抵押債權憑證和分割型抵押擔保證券、商業抵押擔保證券、資產擔保證券與擔保債務憑證。

基本能力或先修課程

經濟學

課程與系所基本素養及核心能力之關連

- 具備財金專業知識與資訊運用能力
- 具備金融商品銷售知識與實踐能力
- 具備為個人與企業進行財務規劃知識與實踐能力
- 具備職業道德、責任感與倫理素養

教學計畫表

| 系所核心能力 | 權重(%) 【A】 | 檢核能力指標(績效指 標) | 教學策略 | 評量方法及配分 權重 | 核心能力 學習成績 【B】 | 期末學習 成績 【C=B*A 】 |
|-----------------------|--------------|-----------------------------------|---------------------|--|---------------------|---------------------------|
| 具備財金專業知識與資訊運用能力 | 30 | 財金專業知識 邏輯推理能力 資料收集與整合應用 | 講述法 校外參訪 個案討論 | 分組報告: 10% 期中考: 30% 期末考: 30% 課程參與度: 20% 書面報告: 10% | 加總: 100 | 30 |
| 具備金融商品銷售知識與實踐能力 | 30 | 財金實務技能 團隊合作 創新思考 人際關係與溝通 | 講述法 校外參訪 個案討論 | 分組報告: 30% 期中考: 10% 期末考: 10% 課程參與度: 30% 書面報告: 20% | 加總: 100 | 30 |
| 具備為個人與企業進行財務規劃知識與實踐能力 | 30 | 財富規劃與投資 主動探索與解決問題 財經情勢分析 | 講述法 校外參訪 個案討論 | 分組報告: 20% 期中考: 20% 期末考: 20% 課程參與度: 20% 書面報告: 20% | 加總: 100 | 30 |
| 具備職業道德、責任感與倫理素養 | 10 | 責任感 財金倫理 社會關懷 | 講述法 校外參訪 個案討論 | 分組報告: 20% 期中考: 10% 期末考: 10% 課程參與度: 30% 書面報告: 30% | 加總: 100 | 10 |

成績稽核

課程參與度: 24%
分組報告: 20%
期末考: 19%
期中考: 19%
書面報告: 18%

書籍類別 (尊重智慧財產權，請用正版教科書，勿非法影印他人著作)

| 書籍類別 | 書名 | 作者 |
|-------------|-----------|---------|
| 參考教材及專業期刊導讀 | 債券市場概論 | 薛立言、劉亞秋 |
| 教科書 | 債券市場理論與實務 | 王澤世 |

上課進度

| 週次 | 教學內容 | 教學策略 |
|----|---------------------------|----------|
| 1 | 導論 & 智財權宣導(含告知學生應使用正版教科書) | 講述法 |
| 2 | 第1章 債券發行 | 講述法、個案討論 |
| 3 | 第2章 債券評價 | 講述法、個案討論 |
| 4 | 第3章 利率風險的衡量 | 講述法、個案討論 |
| 5 | 第4章 利率期限結構 | 講述法、個案討論 |
| 6 | 第4章 利率期限結構 | 講述法、個案討論 |
| 7 | 第5章 債券投資報酬率、風險值及利率趨勢分析 | 講述法 |
| 8 | 第5章 債券投資報酬率、風險值及利率趨勢分析 | 講述法、個案討論 |
| 9 | 期中考 | 期中考 |
| 10 | 第6章 債券交易 | 講述法、個案討論 |
| 11 | 第7章 信用風險衡量 | 講述法、個案討論 |
| 12 | 第7章 信用風險衡量 | 講述法、個案討論 |
| 13 | 第8章 債券操作策略 | 講述法、個案討論 |
| 14 | 第9章 債券創新設計 | 講述法、個案討論 |
| 15 | 第10章 利率衍生商品 | 講述法、個案討論 |
| 16 | 第11章 可轉換公司債 | 講述法、個案討論 |
| 17 | 第12章 資產債券化商品 | 講述法、個案討論 |
| 18 | 期末考 | 期末考 |