

## 98-1 大葉大學 完整版課綱

### 基本資訊

課程名稱	債券市場與投資	科目序號 / 代號	1727 / FBM4002
開課系所	財務金融學系	學制 / 班級	大學日間部4年1班
任課教師	吳勝景	專兼任別	專任
必選修 / 學分數	必修 / 3	畢業班 / 非畢業班	畢業班
上課時段 / 地點	(二)7 / B207 (五)34 / B207	授課語言別	中文

### 課程簡介

A.管理學院SQ ( Society Quotient ; 社會智商 ) 核心能力之四大構面(SCEP) :

- 1.S-解決問題能力 (洞析力、決策力、執行力)
- 2.C-溝通能力 (傾聽能力、表達能力)
- 3.E-倫理觀 (社會倫理、企業倫理、研究倫理)
- 4.P-專業能力 (管理能力-強調商管知識與技能、 研究能力-強調商管研究專業)

B.財務金融系之教育目標 :

- 1.厚植學生職場競爭力
- 2.增進學生責任感與倫理觀

C.財務金融系之核心能力(WE CARE) :

- 1.具備職場專業財金技能(W)
- 2.擁有探索與解決問題的能力(E)
- 3.具有財金資訊蒐集與分析能力(CA)
- 4.具備責任感與倫理素養(RE)

D.本課程目標 :

依據財務金融系之教育目標及核心能力，本課程主要啟發學生對於債券市場相關課程的學習興趣，進而使他們了解理論分析的意涵，除了強調專業能力(W)的培養外，其中亦訓練學生具備其他的核心能力(E、CA、RE)。本課程提供固定收益證券及其衍生金融商品的基礎知識和現代技巧，目的在培養學生有：1.固定收益工具評估與債券市場運作的高深知識。2.操作試算表以應用所學的理论。3.熟悉對固定收益投資組合的風險評估與避險。

此外，本課程將簡介債券人員證照，鼓勵同學多參與證照考試。

本課程亦將配合Cmoney財經分析資料庫課程的使用，讓同學藉由資料庫與課程結合，並配合上機實作，培養學生對財金資訊蒐集、整合與分析應用之能力。

此外，透過i-course線上學習平台，將規劃一系列相關主題進行小組討論與作業，透過線上討論方式，讓學生能透過合作溝通與創新思考，主動發掘並解決問題。

## 課程大綱

本課程著重培育證券期貨專業相關能力，課程主要培養財金系學生具有債券基本概念及總體經濟指標與利率趨勢研判，進行債券評價分析、債券的風險衡量與管理。  
(教學大綱及上課進度視學習狀況、及資料庫說明會調整)

## 基本能力或先修課程

財務管理

## 課程與系所基本素養及核心能力之關連

## 成績稽核

教科書(尊重智慧財產權，請用正版教科書，勿非法影印他人著作)

書名	作者	譯者	出版社	出版年
無參考教科書				

參考教材及專業期刊導讀(尊重智慧財產權，請用正版教科書，勿非法影印他人著作)

書名	作者	譯者	出版社	出版年
無參考教材及專業期刊導讀				

## 上課進度

週次	教學內容	分配時數(%)				
		講授	示範	習作	實驗	其他
1	Ch. 1債券簡介	70		30		
2	Ch. 2債券的發行與交易	70		30		
3	Ch. 3利率期限結構	70		30		
4	Ch. 3利率期限結構	70		30		
5	Ch. 4利率風險衡量	70		30		
6	Ch. 5債券評價進階與投資報酬衡量	70		30		
7	Ch. 6利率模型	70		30		
8	Ch. 7信用風險衡量	70		30		
9	Midterm Exam	0		0		100
10	Ch. 8投資組合風險衡量	70		30		
11	Ch. 9債券投資操作策略	70		30		
12	校外企業參訪	50	50	0		
13	Ch. 10, 11債券創新與設計、利率與信用衍生商品	70		30		
14	Ch. 12浮動利率與結構型債券	70		30		
15	Ch. 13可轉換公司債	70		30		
16	Ch. 14資產證券化	70		30		
17	Final Exam	0		0		100

