

債券市場

99 學年度上學期

李存修教授

課程目標：

- (1)介紹債券市場之運作。 (3)債券投資策略與風險控管。
(2)瞭解債券之評價與風險。 (4)債券之衍生性商品等。

教科書：

Fabozzi, Bond Market, Analysis and Strategies, 7th.ed.,
Prentice-Hall International, 2010 (required , 雙葉)。

課程要求：

期中考 35%、期末考 35%、分組報告 20%、模擬交易 10%。本課程採網路輔助教學，課程內容均在網站上，同學可不作筆記。所有報告均交到網站上，同學須閱讀別組之報告，並提問題，作者則有義務回答。
(課程網站 <http://ceiba.ntu.edu.tw/991bm>)

上課時間和地點：

每週二下午 2:20~5:20/管理學院貳館 305 教室

聯絡方式：電話：02-33661077，傳真：02-23633269

e-mail：tsunsiou@management.ntu.edu.tw

助教：周冠宏 email: b95703089@ntu.edu.tw

課程進度、主題及章節：

週次	日期	主題	主要教科書章節
1	9/14	債券發行市場	1*
2	9/21	債券交易市場	*
3	9/28	債券之種類—公債、公司債與地方政府債	6, 7, 8
4	10/5	國際債券市場	9
5	10/12	債券之報酬率及定價	2, 3
6	10/19	利率風險之衡量	4
7	10/26	結構型債券 (Guest speaker)	*
8	11/2	利率期限結構理論	5
9	11/9	期中考	
10	11/16	金融資產證券化(一)	10, 11, 12
11	11/23	金融資產證券化(二)	13, 14, 15, 16
12	11/30	具選擇權條款之公司債	18
13	12/7	可轉換公司債之分析與評價	20
14	12/14	利率模型	17
15	12/21	利率相關商品之評價	29
16	12/28	債券投資組合管理(一)	23
17	1/4	債券投資組合管理(二)	24, 25
18	1/11	期末考	

* 代表介紹台灣市場狀況