

開南管理學院 92 年度第 2 學期

財務金融學系科目教學計劃表

科目代碼	科目名稱	授課教師	修別	開課年級	學分數	每週時數
	中文：固定收益證券分析		<input type="checkbox"/> 必修 <input checked="" type="checkbox"/> 選修	研究所一	3	3
	英文：Fixed income security	先修課程				
教學目標與內容	1. Understand the characters of fixed income securities. 2. How to use Fixed income securities to do port folio mgmt.					
實施方法	■講解法。□實作法。■討論法。■演習法。□問答法。□其他()。					
評量方式	期中測驗 <input checked="" type="checkbox"/> <input checked="" type="checkbox"/> %。期末測驗 <input checked="" type="checkbox"/> <input checked="" type="checkbox"/> %。平時成績 <input checked="" type="checkbox"/> <input checked="" type="checkbox"/> %。其他 (class presentation) 成績 <input type="checkbox"/> <input type="checkbox"/> %。					
授課使用及參考書籍	(請按作者、書名、版別、出版商、發行地、出版年份、起訖頁數順序填寫)。 Bruce Tuckman/fixed income securities/2nd/wiley/2003/1~505					
科目簡介(可含人綱及教學進度)：						
Week1 : Introduction			Week11 : Midterm /case study			
Week2 : Pricing model			Week12 : Model of term structure			
Week3 : Interest risk/duration			Week13 : Short rate process			
Week4 : Term structure of interest rate			Week14 : Time dependent drift model			
Week5 : Construct yield curve			Week15 : cox-ingersoll-ross model			
Week6 : Continue			Week16 : Case study			
Week7 : Generation of curve fitting			Week17 : Case study			
Week8 : Discussion /case study			Week18 : Final exam			
Week9 : Price sensitivity & Hedge continue						
Week10 : Measure of price sensitivity based on prequel yield shifts						
說明：1.授課教師於學期前填寫本表，經課程委員會審核後，影印分送給教師所屬課程委員會召集人，授課班級所屬系、所及教務處課務組；並於開始上課時，將本內容向學生說明。2.本表於91.4.23第四次校課程委員會討論通過。						

課程委員會召集人：



授課教師：

陳惠美