

淡江大學 100 學年度第 2 學期課程教學計畫表

課程名稱	投資學	授課 教師	王譯賢 YI-HSIEN WANG
	INVESTMENTS		
開課系級	管科系三A	開課 資料	必修 單學期 3學分
	TMGXB3A		
系（所）教育目標			
培育具備良好數理分析能力之初階管理人才，以因應社會各界之需要。			
系（所）核心能力			
A. 培育具有決策分析領域課程學習之基本能力。 B. 培育具有企業經營領域課程學習之基本能力。 C. 培育具有統計分析領域課程學習之基本能力。 D. 培育具有財經分析領域課程學習之基本能力。 E. 培育具有科際整合之能力。 F. 培育具有跨領域學習之能力。 G. 培育具有企業實務吸收之能力。 H. 具有外語運用能力。			
課程簡介	投資學課程強調透過統計與數理方法，解析投資基本概念、投資報酬率與風險之衡量、證券及資本市場介紹、證券價格及其投資分析、股價及其評價、財務分析與技術分析、期貨與選擇權、投資組合及其原則、資本資產定價、多角化投資、資產配置與管理、投資績效評估、效率市場理論。		
	From this course, students are required to apply statistical and mathematical methods to analysis financial data that provides a framework that uses a few basic principles to organize students' thinking including: asymmetric information (agency) problems, transaction costs, apply and demand, asset market equilibrium, efficient market, and measurement and management of risk. It uses financial practitioner's approach to financial markets and institutions through emphasis of an applied managerial perspective that includes some applications.		

本課程教學目標與目標層級、系(所)核心能力相關性

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」、「系(所)核心能力」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其「系(所)核心能力」。單項教學目標若對應「系(所)核心能力」有多項時，則可填列多項「系(所)核心能力」。(例如：「系(所)核心能力」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	系(所)核心能力
1	學生將能夠瞭解投資分析的基本概念與範圍，並瞭解在什麼情況下時間投資分析工具是有用的。	Students will be able to understand basic concepts and scope of the investment analysis and what circumstances are suitable for using these analytical tools.	C2	ADFGH
2	學生將能夠對於較深入的學理及公式推導，進行演練，以致於能增進未來更深入議題的扎實基礎。	Students will be able to learn, derive and practice advanced formulas in order to get firm foundation in depth with advanced topics in future leaning career.	C4	ACDEGH
3	學生將能在瞭解經濟或財務研究議題的情況下，實際搜集資料並利用電腦統計軟體進行分析、解讀與應用。	Students will be able to discover popular investment issues, collect economic or financial data, and use the computer program to get analyzing results. They are also required to interpret or explain the empirical evidence.	C4	ACDEGH

教學目標之教學方法與評量方法

序號	教學目標	教學方法	評量方法
1	學生將能夠瞭解投資分析的基本概念與範圍，並瞭解在什麼情況下時間投資分析工具是有用的。	講述、討論	紙筆測驗、報告、上課表現
2	學生將能夠對於較深入的學理及公式推導，進行演練，以致於能增進未來更深入議題的扎實基礎。	講述、討論	紙筆測驗、報告、上課表現、程式撰寫
3	學生將能在瞭解經濟或財務研究議題的情況下，實際搜集資料並利用電腦統計軟體進行分析、解讀與應用。	講述、討論、模擬	紙筆測驗、報告、上課表現、實證分析

本課程之設計與教學已融入本校校級基本素養與核心能力

淡江大學校級基本素養與核心能力	內涵說明
◇ 表達能力與人際溝通	有效運用中、外文進行表達，能發揮合作精神，與他人共同和諧生活、工作及相處。
◇ 科技應用與資訊處理	正確、安全、有效運用資訊科技，並能蒐集、分析、統整與運用資訊。
◇ 洞察未來與永續發展	能前瞻社會、科技、經濟、環境、政治等發展的未來，發展與實踐永續經營環境的規劃或行動。
◇ 學習文化與理解國際	具備因應多元化生活的文化素養，面對國際問題和機會，能有效適應和回應的全球意識與素養。
◇ 自我了解與主動學習	充分了解自我，管理自我的學習，積極發展自我多元的興趣和能力，培養終身學習的價值觀。
◇ 主動探索與問題解決	主動觀察和發掘、分析問題、蒐集資料，能運用所學不畏挫折，以有效解決問題。
◇ 團隊合作與公民實踐	具備同情心、正義感，積極關懷社會，參與民主運作，能規劃與組織活動，履行公民責任。
◇ 專業發展與職涯規劃	掌握職場變遷所需之專業基礎知能，管理個人職涯的職業倫理、心智、體能和性向。

授 課 進 度 表

週次	日期起訖	內 容 (Subject/Topics)	備 註
1	101/02/13~ 101/02/19	Course Description	
2	101/02/20~ 101/02/26	Investment Environment	
3	101/02/27~ 101/03/04	Asset Class and Financial Instruments	
4	101/03/05~ 101/03/11	How Securities Are Traded I	
5	101/03/12~ 101/03/18	How Securities Are Traded II	
6	101/03/19~ 101/03/25	Mutual Funds and Other Investment Companies I	
7	101/03/26~ 101/04/01	Mutual Funds and Other Investment Companies II	
8	101/04/02~ 101/04/08	Risk Aversion and Capital Allocation to Risky Assets I	
9	101/04/09~ 101/04/15	Risk Aversion and Capital Allocation to Risky Assets II	
10	101/04/16~ 101/04/22	期中考試週	
11	101/04/23~ 101/04/29	The Capital Asset Pricing Model I	
12	101/04/30~ 101/05/06	he Capital Asset Pricing Model II	

13	101/05/07~ 101/05/13	Arbitrage Pricing Theory and Multifactor Models of Risk and Return I	
14	101/05/14~ 101/05/20	Arbitrage Pricing Theory and Multifactor Models of Risk and Return II	
15	101/05/21~ 101/05/27	The Efficient Market Hypothesis I	
16	101/05/28~ 101/06/03	The Efficient Market Hypothesis II	
17	101/06/04~ 101/06/10	Empirical Evidence on Security Returns	
18	101/06/11~ 101/06/17	期末考試週	
修課應 注意事項		Emphasis will be on applying statistical and mathematical methods to analyze real data.	
教學設備		電腦、投影機	
教材課本		Bodie, Kane & Marcus, Investments and Portfolio Management 9E, McGraw-Hill.	
參考書籍		投資學 基本原理與實務 三版，謝劍平，智勝出版社。	
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		◆出席率： 20.0 % ◆平時評量：15.0 % ◆期中評量：30.0 % ◆期末評量：35.0 % ◆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。 ※不法影印是違法的行為。請使用正版教科書，勿不法影印他人著作，以免觸法。	