

淡江大學 100 學年度第 2 學期課程教學計畫表

課程名稱	投資理財分析	授課 教師	莊忠柱 CHUNG-CHU CHUANG
	INVESTMENT AND FINANCIAL ANALYSIS		
開課系級	管科一碩士班 A	開課 資料	選修 單學期 3學分
	TMGXM1A		
系（ 所 ） 教 育 目 標			
培育具備良好數理分析與邏輯判斷能力之中階管理人才，以因應國內外企業之需要。			
系（ 所 ） 核 心 能 力			
A. 培育具有決策分析課程學習之能力。 B. 培育具有企業經營課程學習之能力。 C. 培育具有統計分析課程學習之能力。 D. 培育具有財經分析課程學習之能力。 E. 培育具有科際整合之能力。 F. 培育具有企業實務之能力。 G. 具有外語運用能力。 H. 具有學術論文競賽能力。			
課程簡介	本課程將介紹投資報酬與風險的基本觀念、各種金融市場與工具、投資理論、投資組合理論，冀求給學生一個完整、有系統的思考架構，以厚植學生未來投資決策分析的能力。		
	This course introduces the elements of investment decision-making including the basic investment returns and risk concepts, various financial market and instruments, investment theory and portfolio theory. This course also gives student an integrated and systematic thinking framework and to raise the student with ability of investment decision-making in the future.		

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	1了解各種金融市場與工具	1 to see the various financial market and instruments.	C2	ABCDG
2	2分析各種投資機會	2 to analyze the alternative investment opportunity.	P4	ABCDG
3	3了解投資報酬與風險的抵換	3 to see the tradeoff between returns and risk of investment	C3	ABCDG
4	4如何做好投資組合管理	4 How to manage a portfolio	A5	ABCDEG

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	1了解各種金融市場與工具	講述、討論	報告、上課表現
2	2分析各種投資機會	講述、討論	報告、上課表現
3	3了解投資報酬與風險的抵換	講述、討論	報告、上課表現
4	4如何做好投資組合管理	講述、賞析	報告、上課表現

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	Introduction	
2	101/02/20~ 101/02/26	How securities are traded?	
3	101/02/27~ 101/03/04	Learning about returns and risks from the historical record	
4	101/03/05~ 101/03/11	Risk aversion and capital allocation to risky assets	
5	101/03/12~ 101/03/18	Index model	
6	101/03/19~ 101/03/25	The capital asset pricing model	
7	101/03/26~ 101/04/01	The efficient market hypothesis	
8	101/04/02~ 101/04/08	Behavior finance and technical analysis	
9	101/04/09~ 101/04/15	Bonds price and yields	
10	101/04/16~ 101/04/22	The term structure of interest rates	
11	101/04/23~ 101/04/29	Macroeconomic and industry	
12	101/04/30~ 101/05/06	Equity valuation model	

13	101/05/07~ 101/05/13	Option markets: introduction	
14	101/05/14~ 101/05/20	Option valuation	
15	101/05/21~ 101/05/27	Futures, Swaps, and risk management	
16	101/05/28~ 101/06/03	Portfolio performance evaluation	
17	101/06/04~ 101/06/10	Hedge funds	
18	101/06/11~ 101/06/17	The theory of active portfolio management	
修課應 注意事項			
教學設備		電腦、投影機	
教材課本		Bodie, Z., A. Kane and A. J. Marcus, Investment, McGraw Hill, 2009.(華泰文化代理)	
參考書籍		Jordan, D. B. and Thomas W. Miller, Jr., Fundamentals of Investments: Valuations and Managements, McGraw Hill, 2009.	
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： 30.0 % ◆平時評量：10.0 % ◆期中評量： % ◆期末評量： % ◆其他〈作業〉：60.0 %	
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。	