

淡江大學 100 學年度第 2 學期課程教學計畫表

課程名稱	投資組合管理	授課 教師	段昌文 CHANG-WEN DUAN
	PORTFOLIO MANAGEMENT		
開課系級	財金一博士班 A	開課 資料	選修 單學期 3學分
	TBBMD1A		
系 ( 所 ) 教育目標			
紮實的財務理論基礎與嚴謹的研究方法，培養具國際視野與獨立研究能力之學術人才。			
系 ( 所 ) 核心能力			
<p>A. 奠定紮實的財務金融理論基礎。</p> <p>B. 整合跨領域理論與實務的應用能力。</p> <p>C. 熟稔相關財金研究方法與成果。</p> <p>D. 具備獨立研究的學術能力。</p> <p>E. 提升學生的教學能力。</p> <p>F. 提升學術研究國際化之能力。</p>			
課程簡介	投資的風險與報酬抵換關係，效率的投資，資本資產定價模型推導，投資組合理論，投資組合的方法，市場投資組合因子的尋找，投資組合實證方式的應用，程式的撰寫。		
	The trade-off between risk and return, the efficiency of investment, derived to the capital asset pricing model, portfolio theory, application for portfolio approach, finding the factor to portfolio, and program code writing.		



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	Risk and return	
3	101/02/27~ 101/03/04	Fundamentals of Portfolio	
4	101/03/05~ 101/03/11	Portfolio theory	
5	101/03/12~ 101/03/18	Advanced Portfolio	
6	101/03/19~ 101/03/25	Application to Portfolio	
7	101/03/26~ 101/04/01	Empirical Study on Portfolio 1	
8	101/04/02~ 101/04/08	Empirical Study on Portfolio 2	
9	101/04/09~ 101/04/15	CAPM 1	
10	101/04/16~ 101/04/22	CAPM 2	
11	101/04/23~ 101/04/29	Empirical Study on CAPM	
12	101/04/30~ 101/05/06	Program Code on Empirical Study	

13	101/05/07~ 101/05/13	Fama and Macbeth's empirical methodology I	
14	101/05/14~ 101/05/20	Fama and Macbeth's empirical methodology II	
15	101/05/21~ 101/05/27	Fama and French's empirical methodology I	
16	101/05/28~ 101/06/03	Fama and French's empirical methodology II	
17	101/06/04~ 101/06/10	Paper	
18	101/06/11~ 101/06/17	Final term paper	
修課應 注意事項			
教學設備		電腦、投影機	
教材課本		Portfolio Theory	
參考書籍			
批改作業 篇數		1 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：        %    ◆期中評量：        % ◆期末評量：70.0 % ◆其他〈 〉：        %	
備 考		「教學計畫表管理系統」網址： <a href="http://info.ais.tku.edu.tw/csp">http://info.ais.tku.edu.tw/csp</a> 或由教務處 首頁〈網址： <a href="http://www.acad.tku.edu.tw/index.asp/">http://www.acad.tku.edu.tw/index.asp/</a> 〉教務資訊「教學計畫 表管理系統」進入。 <b>※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。</b>	