

淡江大學 101 學年度第 2 學期課程教學計畫表

課程名稱	資產管理	授課 教師	路祥琛 CHEUNG-SUM LU
	ASSET MANAGEMENT		
開課系級	財金一碩士班 A	開課 資料	必修 單學期 3學分
	TLBXM1A		
系 (所) 教育目標			
以完整進階的財務金融課程，培養具獨立分析、判斷與解決問題的財務專業人才。			
系 (所) 核心能力			
<p>A. 培養進階財務金融理論的知識。</p> <p>B. 提升應用理論與實務技巧。</p> <p>C. 加強邏輯推演的能力。</p> <p>D. 財金研究方法的學習與運用。</p> <p>E. 提升考取高階財金專業證照之能力。</p> <p>F. 具備學術未來深造的潛力。</p>			
課程簡介	討論關於資產管理的議題。		
	In-depth discussions about managing assets in this ever-changing global economy.		

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	資產管理的過程。	The process of asset management.	P5	BD
2	各種管理資產組合的方式。	Portfolio management.	P5	BD
3	衡量資產管理的績效。	Performance evaluation.	A3	BD

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	資產管理的過程。	講述、討論	紙筆測驗、報告、上課表現
2	各種管理資產組合的方式。	講述、討論	紙筆測驗、報告、上課表現
3	衡量資產管理的績效。	講述、討論	紙筆測驗、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

淡江大學校級基本素養	內涵說明
◇ 全球視野	
◇ 洞悉未來	
◇ 資訊運用	
◇ 品德倫理	
◆ 獨立思考	
◇ 樂活健康	
◆ 團隊合作	
◇ 美學涵養	

授課進度表

週次	日期起訖	內容 (Subject/Topics)	備註
1	102/02/18~ 102/02/24	Introduction, 2/19	
2	102/02/25~ 102/03/03	Modern portfolio theory - a review, 2/26	
3	102/03/04~ 102/03/10	Market efficiency and investment philosophy, 3/5	
4	102/03/11~ 102/03/17	Setting portfolio objectives, 3/12	
5	102/03/18~ 102/03/24	Statements of investment policy, 3/19	
6	102/03/25~ 102/03/31	The asset allocation decision, 3/26	3/31前決定報告題目
7	102/04/01~ 102/04/07	Spring Break, NO CLASS, 4/2	
8	102/04/08~ 102/04/14	Managing equity portfolio - equity style, 4/9	
9	102/04/15~ 102/04/21	Managing equity portfolio - equity strategies, 4/16	
10	102/04/22~ 102/04/28	Midterm Exam	
11	102/04/29~ 102/05/05	Managing equity portfolio - trading costs, 4/23	
12	102/05/06~ 102/05/12	Indexing investing, 4/30	

13	102/05/13~ 102/05/19	Managing bond portfolio, 5/7	
14	102/05/20~ 102/05/26	Market timing, 5/14	
15	102/05/27~ 102/06/02	Managing individual investor portfolio, 5/21	
16	102/06/03~ 102/06/09	Managing institutional investor portfolio, 5/28	
17	102/06/10~ 102/06/16	Evaluation of performance, 6/4	
18	102/06/17~ 102/06/23	Final Exam	
修課應 注意事項			
教學設備		電腦、投影機	
教材課本		無	
參考書籍		Investment Analysis and Portfolio Management, 8th Ed. – Reilly and Brown (South-Western). Portfolio Construction, Management, and Protection, 3rd Ed. – Strong (South-Western). Understanding Asset Allocation – Canto (Financial Times Prentice Hall).	
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： 10.0 % ◆平時評量： % ◆期中評量： % ◆期末評量：45.0 % ◆其他〈報告〉：45.0 %	
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。	