

淡江大學 101 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	李彥賢 YEN-HSIEN LEE
	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
	TLBXD1A		
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	投資組合理論之應用：1.報酬與風險2.投資的風險與報酬抵換關係 3.效率市場 4.資本資產定價模型 5.投資組合的方法，以及投資組合相關實證分析。		
	PORTFOLIO MANAGEMENT: 1.Return and Risk, 2.The trade-off between risk and return, 3.The efficiency market, 4.The capital asset pricing model, 5.The application for portfolio approach, 6.The Empirical Analysis of investment portfolio.		

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	投資組合管理應用	The application for portfolio managment	C3	BCDE

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	投資組合管理應用	講述、討論、實作	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	102/02/25~ 102/03/03	Risk and return (Paper Review and Discussion)	
3	102/03/04~ 102/03/10	Random Walking or Walking Randomly (Paper Review and Discussion)	
4	102/03/11~ 102/03/17	Variance Ratio Testing of Asset prices(Paper Review and Discussion)	
5	102/03/18~ 102/03/24	Fundamentals of Portfolio (Paper Review and Discussion)	
6	102/03/25~ 102/03/31	The Capital Asset Pricing Model I (Paper Review and Discussion)	
7	102/04/01~ 102/04/07	Off-campus study (no classes)	
8	102/04/08~ 102/04/14	The Capital Asset Pricing Model II (Paper Review and Discussion)	
9	102/04/15~ 102/04/21	Event Studies (Paper Review and Discussion)	
10	102/04/22~ 102/04/28	The middle exam	
11	102/04/29~ 102/05/05	The hedge and Optimal Portfolio (Paper Review and Discussion)	
12	102/05/06~ 102/05/12	Investigating the Price-Earnings Relationship (Paper Review and Discussion)	

13	102/05/13~ 102/05/19	Presentation and discussion (1)	
14	102/05/20~ 102/05/26	Presentation and discussion (2)	
15	102/05/27~ 102/06/02	Presentation and discussion (3)	
16	102/06/03~ 102/06/09	The Term Paper Presentation I	
17	102/06/10~ 102/06/16	The Term Paper Presentation II	
18	102/06/17~ 102/06/23	The final exam	
修課應 注意事項	授課內容依據上課情況適度修改課程大綱，其他事項於課堂公布。		
教學設備	電腦		
教材課本	Investments		
參考書籍	Modern Portfolio Theory and Investment Analysis Investment Analysis and Portfolio Management		
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：            %   ◆平時評量：            %   ◆期中評量：20.0 % ◆期末評量：20.0 % ◆其他〈報告〉：60.0 %		
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>		