

## 淡江大學 105 學年度第 1 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	管科一碩士班 A	開課 資料	選修 單學期 3學分
	TLGXM1A		
系（所）教育目標			
<p>一、精實管理科學專業。</p> <p>二、學習自我成長。</p> <p>三、連結理論與實務。</p> <p>四、增進團隊合作溝通。</p> <p>五、培養判斷與分析技巧。</p> <p>六、重視組織永續經營。</p>			
系（所）核心能力			
<p>A. 決策分析能力。</p> <p>B. 統計分析能力。</p> <p>C. 財經分析能力。</p> <p>D. 組織經營管理能力。</p> <p>E. 團隊合作能力。</p> <p>F. 自我管理能力。</p> <p>G. 道德倫理能力。</p>			
課程簡介	<p>投資學課程強調透過統計與數理方法，解析投資概念、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。此課程可使學生了解投資學，並可應用於經濟、商業、市場分析及財務金融等領域。</p>		
	<p>From this course, students are required to apply statistical methods to analysis financial data that provides a framework that uses a few 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, such as economics, commerce, market analysis finance.</p>		

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	學生將能夠瞭解經投資學的基本概念與範圍，並瞭解在什麼情況下分析工具是有用的。	Students will be able to understand basic concepts and scope of investments and what circumstances are suitable for using these methods.	C2	ABC
2	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 issues of investments, collect financial data, use the computer program to get analyzing results. They are also required to interpret or explain the empirical evidence.	C3	ABDF
3	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	ABCD

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	學生將能夠瞭解經投資學的基本概念與範圍，並瞭解在什麼情況下分析工具是有用的。	講述、討論	報告、上課表現
2	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、實作	實作、報告、上課表現
3	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、實作	紙筆測驗、實作、報告

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	培養認識國際社會變遷的能力，以更寬廣的視野了解全球化的發展。
◆ 資訊運用	熟悉資訊科技的發展與使用，並能收集、分析和妥適運用資訊。
◆ 洞悉未來	瞭解自我發展、社會脈動和科技發展，以期具備建構未來願景的能力。
◇ 品德倫理	了解為人處事之道，實踐同理心和關懷萬物，反省道德原則的建構並解決道德爭議的難題。
◆ 獨立思考	鼓勵主動觀察和發掘問題，並培養邏輯推理與批判的思考能力。
◇ 樂活健康	注重身心靈和環境的和諧，建立正向健康的生活型態。
◆ 團隊合作	體察人我差異和增進溝通方法，培養資源整合與互相合作共同學習解決問題的能力。
◇ 美學涵養	培養對美的事物之易感性，提升美學鑑賞、表達及創作能力。

授課進度表

週次	日期起訖	內容 (Subject/Topics)	備註
1	105/09/12~ 105/09/18	Course Description	
2	105/09/19~ 105/09/25	Investment Environment	
3	105/09/26~ 105/10/02	Asset Class and Financial Instruments	
4	105/10/03~ 105/10/09	How Securities Are Traded I	
5	105/10/10~ 105/10/16	How Securities Are Traded II	
6	105/10/17~ 105/10/23	Mutual Funds and Other Investment Companies I	
7	105/10/24~ 105/10/30	Mutual Funds and Other Investment Companies II	
8	105/10/31~ 105/11/06	Risk Aversion and Capital Allocation to Risky Assets I	
9	105/11/07~ 105/11/13	Risk Aversion and Capital Allocation to Risky Assets II	
10	105/11/14~ 105/11/20	期中考試週	
11	105/11/21~ 105/11/27	The Capital Asset Pricing Model I	
12	105/11/28~ 105/12/04	The Capital Asset Pricing Model II	

13	105/12/05~ 105/12/11	Arbitrage Pricing Theory and Multifactor Models of Risk and Return I	
14	105/12/12~ 105/12/18	Arbitrage Pricing Theory and Multifactor Models of Risk and Return II	
15	105/12/19~ 105/12/25	The Efficient Market Hypothesis I	
16	105/12/26~ 106/01/01	The Efficient Market Hypothesis II	
17	106/01/02~ 106/01/08	Empirical Evidence on Security Returns	
18	106/01/09~ 106/01/15	期末考試週	
修課應 注意事項			
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		陳旭昇, 2009年, 時間序列分析-總體經濟與財務金融之應用, 東華書局 Tsay, R. S. Analysis of Financial Time Series. 2005, Second Edition. 謝劍平, 投資學 基本原理與實務, 智勝出版	
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: 15.0 %    ◆平時評量: 15.0 %    ◆期中評量: 20.0 % ◆期末評量: 30.0 % ◆其他〈報告〉: 20.0 %	
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/CS/main.php">http://www.acad.tku.edu.tw/CS/main.php</a> 〉業務連結「教師教學 計畫表上傳下載」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>	