

淡江大學 106 學年度第 2 學期課程教學計畫表

課程名稱	投資分析	授課教師	黃寶玉
	INVESTMENT ANALYSIS		
開課系級	管科企經碩一 A	開課資料	選修 單學期 2學分
	TLGAM1A		
系（所）教育目標			
一、精實管理科學專業。 二、學習自我成長。 三、連結理論與實務。 四、增進團隊合作溝通。 五、培養判斷與分析技巧。 六、重視組織永續經營。			
系（所）核心能力			
A. 決策分析能力。 B. 統計分析能力。 C. 財經分析能力。 D. 組織經營管理能力。 E. 團隊合作能力。 F. 自我管理能力。 G. 道德倫理能力。			
課程簡介	本課程的教學目標以財務計量方法之應用為主，期使同學結合財務理論與計量實證方法，探討財務資料型態、模型選擇及實證結果解釋，內容聚焦於財務理論核心的報酬與風險之量測，以進一步應用於分析、驗證各種實務性的投資專題。		
	The purpose of this course is to teach the application of financial econometrics, through readings and studying of investment articles, assist students integrating the financial theory and empirical methods, investigate the patterns of financial data, select the appropriate model, and interpret the empirical results. The main content focuses on the measurement of financial returns and risks, analyze and validate the various investment topics.		

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	本課程的教學目標以財務計量方法之應用為主，期使同學結合財務理論與計量實證方法，探討財務資料型態、模型選擇及實證結果解釋，內容聚焦於財務理論核心的報酬與風險之量測，以進一步應用於分析、驗證各種實務性的投資專題。	The purpose of this course is to teach the application of financial econometrics, through readings and studying of investment articles, assist students integrating the financial theory and empirical methods, investigate the patterns of financial data, select the appropriate model, and interpret the empirical results. The main content focuses on the measurement of financial returns and risks, analyze and validate the various investment topics.	P3	ABCDEFGF

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	本課程的教學目標以財務計量方法之應用為主，期使同學結合財務理論與計量實證方法，探討財務資料型態、模型選擇及實證結果解釋，內容聚焦於財務理論核心的報酬與風險之量測，以進一步應用於分析、驗證各種實務性的投資專題。	講述、討論、模擬、實作、問題解決	實作、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	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	107/02/26~ 107/03/04	Introduction to the course	
2	107/03/05~ 107/03/11	Introduction to financial econometrics	
3	107/03/12~ 107/03/18	Hypothesis test and application	
4	107/03/19~ 107/03/25	Market model: simple regression model	
5	107/03/26~ 107/04/01	Futures hedging: simple regression model	
6	107/04/02~ 107/04/08	CAPM model: simple regression model	
7	107/04/09~ 107/04/15	Weekend/January effect: dummy variable application	
8	107/04/16~ 107/04/22	ARIMA model	
9	107/04/23~ 107/04/29	Reward forecast : ARIMA model	
10	107/04/30~ 107/05/06	Midterm Exam Week	
11	107/05/07~ 107/05/13	VAR model	
12	107/05/14~ 107/05/20	Spot and Futures: VAR model	

13	107/05/21~ 107/05/27	Spot and Futures: VECM model	
14	107/05/28~ 107/06/03	GARCH model	
15	107/06/04~ 107/06/10	Risk variations and leverage effects: GARCH Model	
16	107/06/11~ 107/06/17	Panel Data model	
17	107/06/18~ 107/06/24	Firm value: Panel Data model	
18	107/06/25~ 107/07/01	Final Exam Week	
修課應 注意事項			
教學設備		電腦、投影機	
教材課本		鍾惠民、周賓鳳、孫而音(2011), 財務計量：E-VIEWS的應用, 最新版, 新陸書局。	
參考書籍			
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： 20.0 % ◆平時評量： % ◆期中評量：40.0 % ◆期末評量：40.0 % ◆其他〈 〉： %	
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/CS/main.php 〉業務連結「教師教學 計畫表上傳下載」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。	