

淡江大學 107 學年度第 2 學期課程教學計畫表

課程名稱	投資決策分析	授課 教師	邱文昌 CHIU, WEN-CHANG
	INVESTMENT DECISION ANALYSIS		
開課系級	財金一碩專班 A	開課 資料	選修 單學期 3學分
	TLBXJ1A		
系 (所) 教育目標			
提供財務金融產業人才之專業訓練課程，以落實實務與理論融合應用之能力。			
系 (所) 核心能力			
<p>A. 具備理論與實務融合應用之能力。</p> <p>B. 具備個案研究與分析的能力。</p> <p>C. 培養具備企業財務決策與分析之能力。</p> <p>D. 發展專業競爭的能力與態度。</p> <p>E. 提升財金研究理論與方法之素養。</p> <p>F. 提升考取高階財金專業證照之能力。</p>			
課程簡介	<p>投資決策分析課程涵括投資概論及金融市場投資商品(權益證券,固定收益證券,衍生性商品如權證 ETF, ETN 期貨選擇權結構型商品等)特性,性質,市場架構,參與者,交易制度及實務,與法規介紹,並進而對投資理論發展投資組合,資產配置,報酬與風險關係與衡量,商品評價,基本分析,技術分析等加以探討. 另研討整體投資程序與績效評估,與投資決策檢討,使學習者深入了解投資所有面向及有效運用於實際投資實務之上.</p>		
	<p>We discuss the the concept of investment, types of securities traded in markets, and explain how and where securities are traded. This course also contains portfolio theory, risk – return trade-off, the capital asset pricing model and multifactor descriptions of risk and the arbitrage pricing theory the efficient market hypothesis, the behavioral critique of market rationality,the process of investment decision and performance valuation.</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	使學習者了解投資概念及金融市場投資商品特性,並進而對投資理論發展,投資組合,資產配置,報酬與風險關係與衡量,商品評價,基本分析,技術分析有所認識,對整體投資程序與績效評估與投資決策檢討,使學習者有效運用於實際投資實務之上	The goal of this course is making the learner understand the the concept of investment, types of securities traded in markets, and explain how and where securities are traded.It also contains portfolio theory, risk - return trade-off, the capital asset pricing model and multifactor descriptions of risk and the arbitrage pricing theory the efficient market hypothesis, the behavioral critique of market rationality,the process of investment decision and performance valuation.	A6	ABCDEF

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	使學習者了解投資概念及金融市場投資商品特性,並進而對投資理論發展,投資組合,資產配置,報酬與風險關係與衡量,商品評價,基本分析,技術分析有所認識,對整體投資程序與績效評估與投資決策檢討,使學習者有效運用於實際投資實務之上	講述、討論、實作、參訪、問題解決	紙筆測驗、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	108/02/18~ 108/02/24	投資之基本概念	
2	108/02/25~ 108/03/03	投資之要素	
3	108/03/04~ 108/03/10	報酬與風險之衡量	
4	108/03/11~ 108/03/17	風險之種類與預防偵測	
5	108/03/18~ 108/03/24	金融制度 市場與金融商品	
6	108/03/25~ 108/03/31	證券金融商品	
7	108/04/01~ 108/04/07	衍生性金融商品	
8	108/04/08~ 108/04/14	投資理論發展概論	
9	108/04/15~ 108/04/21	證券之評價	
10	108/04/22~ 108/04/28	基本分析, 技術分析	
11	108/04/29~ 108/05/05	投資組合分析 CAPM APT	
12	108/05/06~ 108/05/12	效率市場與市場異象	

13	108/05/13~ 108/05/19	行為財務學	
14	108/05/20~ 108/05/26	投資策略與績效衡量	
15	108/05/27~ 108/06/02	證券制度實務篇	
16	108/06/03~ 108/06/09	證券制度實務篇	
17	108/06/10~ 108/06/16	金融創新與金融科技	
18	108/06/17~ 108/06/23	期末評量	
修課應 注意事項			
教學設備		電腦、投影機	
教材課本		Bodie,Z., Kane, A., and Marcus, a. j.,Investment, McGraw-Hill Com., 11th ed.,2018	
參考書籍		1. Foundations of portfolio theory – Markowitz (Journal of finance Vol. 46 Is. 2-1991) 2. William F Sharpe – 1964 – Capital Asset Prices – A Theory Of Market Equilibrium Under Conditions Of Risk – The Journal Of Finance 2. William F Sharpe – 1964 – Capital Asset Prices – A Theory Of Market Equilibrium Under Conditions Of Risk – The Journal Of Finance 3. Fama, Eugene F, 1991, Efficient Capital Markets II, Journal of Finance 46, 1575-1617. 4.. Hong, Harrison, and Jeremy C. Stein, 1999, A Unified Theory of Underreaction, Momentum Trading and Overreaction in Asset Markets, Journal of Finance 54, 2143-2184.	
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： 10.0 % ◆平時評量：20.0 % ◆期中評量：30.0 % ◆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。	