

淡江大學 108 學年度第 1 學期課程教學計畫表

課程名稱	證券分析與實務	授課 教師	陳育欣 CHEN, YU-HSIN
	SECURITY ANALYSIS AND PRACTICE		
開課系級	管科系四 P	開課 資料	實體課程 選修 單學期 3學分
	TLGXB4P		
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>			
本課程對應院、系(所)核心能力之項目與比重			
<p>C. 統計與決策分析能力。(比重：10.00)</p> <p>D. 財經分析能力。(比重：50.00)</p> <p>E. 團隊合作能力。(比重：20.00)</p> <p>F. 自我管理能力。(比重：10.00)</p> <p>G. 道德倫理能力。(比重：10.00)</p>			
本課程對應校級基本素養之項目與比重			
<p>1. 全球視野。(比重：25.00)</p> <p>2. 資訊運用。(比重：20.00)</p> <p>4. 品德倫理。(比重：20.00)</p> <p>7. 團隊合作。(比重：35.00)</p>			
課程簡介	<p>本課程為實務與理論兼具的課程。有系統地介紹證券市場，並以文獻探討各種證券投資理論及其發展。以總體經濟分析、產業分析、財務報表分析及技術分析等方法培養對市場的敏感度。建立對證券投資之系統性思考架構，提升學術研究與投資決策分析的能力。</p>		

	This course combines practical and theoretical. Introduce the securities market systematically and explore various securities investment theories and their development. The sensitivity to the market is cultivated by methods such as macroeconomics analysis, industry analysis, firm analysis, financial statement analysis, and technical analysis. Establish a systematic thinking structure for securities investment and enhance the ability of academic research and investment decision analysis.
--	---

本課程教學目標與認知、情意、技能目標之對應

將課程教學目標分別對應「認知 (Cognitive)」、「情意 (Affective)」與「技能(Psychomotor)」的各目標類型。

- 一、認知(Cognitive)：著重在該科目的事實、概念、程序、後設認知等各類知識之學習。
- 二、情意(Affective)：著重在該科目的興趣、倫理、態度、信念、價值觀等之學習。
- 三、技能(Psychomotor)：著重在該科目的肢體動作或技術操作之學習。

序號	教學目標(中文)	教學目標(英文)
1	認識各種證券及其市場	Learn about various securities and their markets
2	熟悉各種投資分析理論	Familiar with various investment analysis theories
3	培養財經資訊解讀與實務操作之能力	Enhance the ability to interpret and practice financial information

教學目標之目標類型、核心能力、基本素養教學方法與評量方式

序號	目標類型	院、系(所)核心能力	校級基本素養	教學方法	評量方式
1	情意	DG	12	講述、討論	測驗、作業、討論(含課堂、線上)
2	認知	CDE	247	講述、討論、體驗	作業、討論(含課堂、線上)、報告(含口頭、書面)
3	技能	CDF	1247	講述、討論、體驗	測驗、作業、討論(含課堂、線上)、報告(含口頭、書面)

授課進度表

週次	日期起訖	內容 (Subject/Topics)	備註
1	108/09/09~ 108/09/15	證券·投資概論	
2	108/09/16~ 108/09/22	證券市場介紹	
3	108/09/23~ 108/09/29	投資理論發展 / 投資組合理論	
4	108/09/30~ 108/10/06	資本資產定價模型(CAPM) — 資本定價理論的演進	
5	108/10/07~ 108/10/13	國慶紀念日 (放假一天)	

6	108/10/14~ 108/10/20	多因子模型 — 從大師經典期刊認識論文寫作	
7	108/10/21~ 108/10/27	效率市場假說	
8	108/10/28~ 108/11/03	展望理論與行為財務觀點	
9	108/11/04~ 108/11/10	近代投資理論發展	
10	108/11/11~ 108/11/17	期中考試週	
11	108/11/18~ 108/11/24	總體經濟分析	
12	108/11/25~ 108/12/01	產業分析	
13	108/12/02~ 108/12/08	基本面與財報分析	
14	108/12/09~ 108/12/15	技術分析 — 基礎	
15	108/12/16~ 108/12/22	技術分析 — 進階	
16	108/12/23~ 108/12/29	投資策略	
17	108/12/30~ 109/01/05	證券投資理論與實務的融合	
18	109/01/06~ 109/01/12	期末考試週(本學期期末考試日期為:109/1/3-109/1/9)	
修課應 注意事項			
教學設備		電腦、投影機	
教科書與 教材		財務管理與分析 作者：倪衍森	
參考文獻		William F. Sharpe, 1964. "Capital Asset Prices: A Theory Of Market Equilibrium Under Conditions Of Risk," Journal of Finance, vol. 19(3), pages 425-442, September. Fama, E. F. (1991), "Efficient Capital Market: II." Journal of Finance , 46, No.12, pp.1575-612 Harry M. Markowitz (1991) "Foundations of Portfolio Theory" Journal of Finance, Vol. 46 Is. 2 Kahneman, D., Tversky, A. (1979) "Prospect theory: An analysis of decisions under risk." Econometrica, 47(2), 263 - 291 Fama, Eugene F., and Kenneth R. French. (1992) "The Cross-Section of Expected Stock Returns," Journal of Finance 47 : 427—465. 投資學 財團法人中華民國證券暨期貨市場發展基金會 邱文昌修訂 徐燕山審定	

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：40.0 %    ◆期中評量：25.0 % ◆期末評量：25.0 % ◆其他〈 〉：        %
備 考	「教學計畫表管理系統」網址： <a href="https://info.ais.tku.edu.tw/csp">https://info.ais.tku.edu.tw/csp</a> 或由教務處 首頁→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>