

淡江大學 1 1 1 學年度第 1 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	實體課程 選修 單學期 3學分
	TLBXJ1A		
課程與SDGs 關聯性	SDG3 良好健康和福祉 SDG4 優質教育 SDG8 尊嚴就業與經濟發展 SDG12 負責任的消費與生產		
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。			
本課程對應院、系(所)核心能力之項目與比重			
A. 具備理論與實務融合應用之能力。(比重：30.00) B. 具備個案研究與分析的能力。(比重：20.00) C. 培養具備企業財務決策與分析之能力。(比重：20.00) D. 發展專業競爭的能力與態度。(比重：5.00) E. 提升財金研究理論與方法之素養。(比重：20.00) F. 提升考取高階財金專業證照之能力。(比重：5.00)			
本課程對應校級基本素養之項目與比重			
1. 全球視野。(比重：5.00) 2. 資訊運用。(比重：20.00) 3. 洞悉未來。(比重：5.00) 4. 品德倫理。(比重：20.00) 5. 獨立思考。(比重：30.00) 6. 樂活健康。(比重：5.00) 7. 團隊合作。(比重：10.00) 8. 美學涵養。(比重：5.00)			
課程簡介	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.		

	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.
--	---

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	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.
2	了解投資概論及金融市場投資商品特性,性質,市場架構,參與者,交易制度及實務,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.	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.
3	了解投資理論與實務,具備理論與實務融合應用之能力,提升財金研究理論與方法之素養具備個案研究與分析的能力.	
4	具備理論與實務融合應用之能力,具備個案研究與分析的能力,提升財金研究理論與方法之素養	

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	認知	ABCDEF	12345678	講述、討論、發表、實作、模擬	測驗、作業、討論(含課堂、線上)、實作、報告(含口頭、書面)

2	技能	ABCDEF	123457	講述、討論、發表、實作、模擬	測驗、作業、討論(含課堂、線上)、實作、報告(含口頭、書面)
3	認知	ABCEF	12357	講述、討論、實作、模擬	測驗、作業、實作、報告(含口頭、書面)
4	技能	ABCDE	12357	講述、討論、發表、實作、模擬	測驗、作業、討論(含課堂、線上)、實作、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	111/09/05~ 111/09/11	投資之基本概念	
2	111/09/12~ 111/09/18	投資之要素	
3	111/09/19~ 111/09/25	報酬與風險之衡量	
4	111/09/26~ 111/10/02	風險之種類與預防偵測	
5	111/10/03~ 111/10/09	金融市場概況與發展	
6	111/10/10~ 111/10/16	證券金融商品	
7	111/10/17~ 111/10/23	衍生性金融商品	
8	111/10/24~ 111/10/30	投資理論發展概論	
9	111/10/31~ 111/11/06	期中考試週	
10	111/11/07~ 111/11/13	證券之評價	
11	111/11/14~ 111/11/20	投資組合分析 CAPM APT	
12	111/11/21~ 111/11/27	效率市場與市場異象	
13	111/11/28~ 111/12/04	行為財務學	
14	111/12/05~ 111/12/11	投資策略與績效衡量	
15	111/12/12~ 111/12/18	證券制度實務篇	
16	111/12/19~ 111/12/25	期末評量	
17	111/12/26~ 112/01/01	證券制度實務篇	
18	112/01/02~ 112/01/08	教師彈性補充教學： 金融創新與金融科技	

修課應注意事項	
教學設備	電腦、投影機
教科書與教材	邱文昌等 2022 投資學 全華圖書
參考文獻	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： https://info.ais.tku.edu.tw/csp 或由教務處首頁→教務資訊「教學計畫表管理系統」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。