

# 淡江大學114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	蔡云瀞 YUN-CHING TSAI			
	INVESTMENTS					
開課系級	管科系三A	開課資料	實體課程 選修 單學期 3學分			
	TLGXB3A					
課程與SDGs 關聯性	SDG4 優質教育					
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>A. 事業經營管理能力。(比重：5.00)</p> <p>B. 行銷與流通管理能力。(比重：5.00)</p> <p>C. 統計與決策分析能力。(比重：30.00)</p> <p>D. 財經分析能力。(比重：40.00)</p> <p>E. 團隊合作能力。(比重：5.00)</p> <p>F. 自我管理能力。(比重：10.00)</p> <p>G. 道德倫理能力。(比重：5.00)</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：30.00)</p> <p>2. 資訊運用。(比重：25.00)</p> <p>3. 洞悉未來。(比重：5.00)</p> <p>4. 品德倫理。(比重：5.00)</p> <p>5. 獨立思考。(比重：20.00)</p> <p>6. 樂活健康。(比重：5.00)</p> <p>7. 團隊合作。(比重：5.00)</p> <p>8. 美學涵養。(比重：5.00)</p>						

課程簡介	本課程協助學生了解風險與報酬的衡量方法，掌握投資組合理論基礎，並應用資本資產定價模型 (CAPM) 與多因子模型。課程同時涵蓋債券與股票的評價原理。學生將能理解現代投資理論的發展，並熟悉實務中常用的投資工具與方法。課程以中文授課，教材與主要資料為英文。
	This course helps students understand how to measure risk and return, grasp portfolio theory fundamentals, and apply the Capital Asset Pricing Model (CAPM) and multifactor models. It also covers bond and stock valuation. By the end of the course, students will understand modern investment theory and be familiar with key tools used in investment practice. Teaching is in Mandarin Chinese, with English textbooks and materials.

### 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	本課程介紹風險與報酬的衡量方法，投資組合理論，資本資產定價模型 (CAPM) 與多因子模型的應用，並涵蓋債券與股票評價，協助學生理解現代投資理論及相關實務工具。	This course covers the measurement of risk and return, portfolio theory, applications of the Capital Asset Pricing Model (CAPM) and multifactor models, as well as bond and stock valuation. It helps students understand modern investment theory and related practical tools.

### 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	ABCDEFG	12345678	講述、實作	測驗、作業

### 授課進度表

週次	日期起訖	內容 (Subject/Topics)	備註
1	114/09/15~ 114/09/21	Course Overview (課程介紹)	
2	114/09/22~ 114/09/28	Risk Aversion and Capital Allocation to Risky Assets (風險規避與風險性資產的資本分配)	
3	114/09/29~ 114/10/05	Optimal Risky Portfolios (最適風險性投資組合)	
4	114/10/06~ 114/10/12	Optimal Risky Portfolios (最適風險性投資組合)	
5	114/10/13~ 114/10/19	Index Models (指數模型)	

6	114/10/20~ 114/10/26	The Capital Asset Pricing Model (資本資產定價模型)	
7	114/10/27~ 114/11/02	The Capital Asset Pricing Model (資本資產定價模型)	
8	114/11/03~ 114/11/09	Midterm exam (期中考)	
9	114/11/10~ 114/11/16	Arbitrage Pricing Theory and Multifactor Models of Risk and Return (套利定價理論與多因子模型)	
10	114/11/17~ 114/11/23	The Efficient Market Hypothesis (效率市場假說)	
11	114/11/24~ 114/11/30	Bond Prices and Yields (債券價格與殖利率)	
12	114/12/01~ 114/12/07	Managing Bond Portfolios (債券投資組合管理)	
13	114/12/08~ 114/12/14	Equity Valuation Models (權益評價模型)	
14	114/12/15~ 114/12/21	Equity Valuation Models (權益評價模型)	
15	114/12/22~ 114/12/28	Portfolio Performance Evaluation (投資組合績效評估)	
16	114/12/29~ 115/01/04	Final Exam (期末考)	
17	115/01/05~ 115/01/11	Flex Week (期末多元評量週/教師彈性教學週)	
18	115/01/12~ 115/01/18	Flex Week (教師彈性教學週)	
課程培養 關鍵能力	自主學習		
跨領域課程			
特色教學 課程			
課程 教授內容	邏輯思考		
修課應 注意事項	只要你有學習動機並願意投入，本課程會循序引導；課程難度與節奏將視班上學習狀況彈性調整。		
教科書與 教材	採用他人教材：教科書 教材說明： Zvi Bodie, Alex Kane, and Alan J. Marcus, Investments, Thirteenth Edition, McGraw-Hill Education, New York, NY, U.S.A., 2024		
參考文獻			

學期成績 計算方式	<p>◆出席率： 15.0 % ◆平時評量：15.0 % ◆期中評量：30.0 %</p> <p>◆期末評量：40.0 %</p> <p>◆其他〈 〉： %</p>
備 考	<p>「教學計畫表管理系統」網址：<a href="https://web2.ais.tku.edu.tw/csp">https://web2.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。</p> <p><b>※「遵守智慧財產權觀念」及「不得不法影印、下載及散布」。請使用正版教科書，勿不法影印他人著作，以免觸法。</b></p>