

淡江大學 114 學年度第 1 學期課程教學計畫表

課程名稱	投資理論研討	授課 教師	顧廣平 KU KUANG-PING
	SEMINAR ON INVESTMENT THEORY		
開課系級	財金一博士班 A	開課 資料	實體課程 選修 單學期 3學分
	TLBXD1A		
課程與SDGs 關聯性	SDG4 優質教育		
系（所）教育目標			
紮實的財務理論基礎與嚴謹的研究方法，培養具國際視野與獨立研究能力之學術人才。			
本課程對應院、系(所)核心能力之項目與比重			
A. 奠定紮實的財務金融理論基礎。(比重：30.00) B. 整合跨領域理論與實務的應用能力。(比重：10.00) C. 熟稔相關財金研究方法與成果。(比重：20.00) D. 具備獨立研究的學術能力。(比重：20.00) E. 提升學生的教學能力。(比重：10.00) F. 提升學術研究國際化之能力。(比重：10.00)			
本課程對應校級基本素養之項目與比重			
1. 全球視野。(比重：10.00) 2. 資訊運用。(比重：20.00) 3. 洞悉未來。(比重：20.00) 4. 品德倫理。(比重：5.00) 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：5.00) 8. 美學涵養。(比重：5.00)			
課程簡介	課程目標是研討"財務理論"資格考之期刊文獻，以利通過資格考，課程以期刊論文研討方式介紹投資學的基本理論-投資組合原理，資產定價理論，因子模式，市場異常，投資策略，事件研究，市場效率，行為財務及最近投資學領域的新發展。		

	Using paper discuss to introduce the basic investment theory--including portfolio theory, asset pricing theories, factor models, market anomalies, investment strategies, event studies, market efficiency, behavioral finance, and recently development of investment area.
--	--

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	了解投資基本理論建立學生未來投資分析與研究能力的基礎	Understanding the basic financial theory to create the research ability of investment analysis for students.

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	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	114/09/15~ 114/09/21	課程簡介：現代投資理論 (Course Introduction: Modern Investment Theory)	
2	114/09/22~ 114/09/28	投資組合理論(Portfolio Theory)	
3	114/09/29~ 114/10/05	資產定價理論 (Asset Pricing Theories)	
4	114/10/06~ 114/10/12	橫斷面異常(Cross-Sectional Anomalies)	
5	114/10/13~ 114/10/19	時間序列異常(Time-Series Anomalies)	
6	114/10/20~ 114/10/26	因子模式(Factor Models) (I)	
7	114/10/27~ 114/11/02	因子模式(Factor Models) (II)	
8	114/11/03~ 114/11/09	定價模式的實證檢定(Empirical Tests of the Pricing Models) (I)	
9	114/11/10~ 114/11/16	定價模式的實證檢定(Empirical Tests of the Pricing Models) (II)	
10	114/11/17~ 114/11/23	逆向投資策略(Contrarian Investment Strategies)	

11	114/11/24~ 114/11/30	動能投資策略(Momentum investment strategy) (I)	
12	114/12/01~ 114/12/07	動能投資策略(Momentum investment strategy) (II)	
13	114/12/08~ 114/12/14	事件研究法(Event-Study Methodology)	
14	114/12/15~ 114/12/21	長期事件研究(Long-Run Event Studies)	
15	114/12/22~ 114/12/28	績效衡量(Performance Measurement)	
16	114/12/29~ 115/01/04	市場效率(Market Efficiency)	
17	115/01/05~ 115/01/11	教師彈性教學週(原則上不上實體課程，得安排教學活動或期末評量等)	
18	115/01/12~ 115/01/18	教師彈性教學週(原則上不上實體課程，得安排教學活動或期末評量等)	
課程培養 關鍵能力			
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		Paper list will be given at first class and upload on iClass. 課程目標是研討"財務理論"資格考之期刊文獻，以利通過資格考 本課程為"財務理論"資格考之必選課程	
教科書與 教材		自編教材：簡報	
參考文獻			
學期成績 計算方式		◆出席率：            %    ◆平時評量：20.0   %    ◆期中評量：            % ◆期末評量：            % ◆其他〈報告與發表〉：80.0   %	

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>※「遵守智慧財產權觀念」及「不得非法影印、下載及散布」。請使用正版教科書，勿非法影印他人著作，以免觸法。</p>
-----	---