

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						
<p>A. 奠定紮實的財務金融理論基礎。(比重：30.00)</p> <p>B. 整合跨領域理論與實務的應用能力。(比重：10.00)</p> <p>C. 熟稔相關財金研究方法與成果。(比重：20.00)</p> <p>D. 具備獨立研究的學術能力。(比重：20.00)</p> <p>E. 提升學生的教學能力。(比重：10.00)</p> <p>F. 提升學術研究國際化之能力。(比重：10.00)</p>						
本課程對應校級基本素養之項目與比重						
<ol style="list-style-type: none"> 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：https://web2.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。</p> <p style="color: red;">※「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。</p>
-----	---