

淡江大學 99 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	段昌文 Chang-wen Duan
	INVESTMENTS		
開課系級	財金三 C	開課 資料	必修 上學期 2學分
	TBBXB3C		
學 系(門) 教 育 目 標			
配合本校、院教育目標，因應國內外金融情勢的演變，培養財務金融理論與實務兼具的財務金融人才。			
學 生 基 本 能 力			
A. 具備財務金融理論與實務的基本知識。 B. 加強相關金融法規的學習。 C. 培養財務金融職場的基本倫理與道德。 D. 提升學生的國際觀與外語能力。 E. 提升學生專業證照之能力。 F. 具有國際化、資訊化、未來化之願景規劃基本能力。 G. 具備審視國內外金融發展情勢之基本能力。 H. 培訓學生獨立、因應及解決問題的基本能力。			
課程簡介	提供學生理解投資學中之資本市場的運作原理，涵蓋投資的基本分析工具。教學目的是讓學生了解機構投資者應用投資組合分析的概念。內容涵蓋主題包括的評價,風險分析,投資組合,capm,市場微觀結構,,套利定價模型,債券和普通股評價,效率市場假說,投資管理及衍生商品。學生透過課程將學習到如何建立適當的投資標的，形成最佳的投資組合策略，權衡與估計風險與報酬，進一步並評估投資的績效。		
	This course provides students with a general understanding of the operation of capital markets and basic analytical tools of investment management. This course is designed to acquaint the student with the concepts of portfolio analysis in the general area of institutional investment management. Specifically, the course covers such topics as valuation, risk analysis, portfolio,..etc. Students will learn how to establish appropriate investment objectives, develop optimal portfolio strategies, estimate risk-return tradeoffs, and evaluate investment performance.		

本課程教學目標與目標層級、學生基本能力相關性

一、目標層級(選填)：

- (一)「認知」(Cognitive 簡稱C)領域：C1 記憶、C2 瞭解、C3 應用、C4 分析、C5 評鑑、C6 創造
- (二)「技能」(Psychomotor 簡稱P)領域：P1 模仿、P2 機械反應、P3 獨立操作、P4 聯結操作、P5 自動化、P6 創作
- (三)「情意」(Affective 簡稱A)領域：A1 接受、A2 反應、A3 重視、A4 組織、A5 內化、A6 實踐

二、教學目標與「目標層級」、「學生基本能力」之相關性：

- (一)請先將課程教學目標分別對應前述之「認知」、「技能」與「情意」的各目標層級，惟單項教學目標僅能對應C、P、A其中一項。
- (二)若對應「目標層級」有1~6之多項時，僅填列最高層級即可(例如：認知「目標層級」對應為C3、C5、C6項時，只需填列C6即可，技能與情意目標層級亦同)。
- (三)再依據所訂各項教學目標分別對應該系「學生基本能力」。單項教學目標若對應「學生基本能力」有多項時，則可填列多項「學生基本能力」(例如：「學生基本能力」可對應A、AD、BEF時，則均填列)。

序號	教學目標(中文)	教學目標(英文)	相關性	
			目標層級	學生基本能力
1	1.投資分析 2.投資決策 3.投資組合	After completing the course, participants should be able to: 1. Investment analysis 2. Investment decision 3. Portfolio	C4	ABEGH

教學目標之教學策略與評量方法

序號	教學目標	教學策略	評量方法
1	1.投資分析 2.投資決策 3.投資組合	課堂講授、分組討論	出席率、報告、期中考、期末考

授課進度表

週次	日期	內容 (Subject/Topics)	備註
1	09/13	課程簡介/ introduction	
2	09/20	投資環境介紹/ The Investment Environment	
3	09/27	貨幣市場與債券市場/Money and Bond Markets	
4	10/04	權益證券、指數與衍生性商品市場/Equity Securities, Indexes, and Derivative Markets	
5	10/11	有價證券的交易-發行與交易/ How Securities are Traded-Issue and Traded	
6	10/18	有價證券的交易-全球證券市場/ How Securities are Traded-Global Securities Markets	
7	10/25	如何交易有價證券/ How Securities are Traded	

8	11/01	共同基金/Mutual Funds	
9	11/08	基金公司/ Investment Companies /複習	
10	11/15	期中考試週	
11	11/22	統計概念複習/Interest Rate/利率	
12	11/29	風險與報酬/ Return and Risk	
13	12/06	風險趨避與資本配置/ Risk Aversion and Capital Allocation	
14	12/13	投資組合與資本市場線/Portfolio and Capital Market Line	
15	12/20	多元分散投資組合/Diversification	
16	12/27	最適風險性組合與 CAPM /Optimal Risky Portfolios and CAPM	
17	01/03	指數模型/Index Models/複習	
18	01/10	期末考試週	
修課應 注意事項			
教學設備		電腦	
教材課本		投資學/Investment/by Bodie	
參考書籍			
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		◆平時考成績：20.0 % ◆期中考成績：35.0 % ◆期末考成績：45.0 % ◆作業成績： % ◆其他〈 〉： %	
備 考		「教學計畫表管理系統」網址： http://info.ais.tku.edu.tw/csp 或由教務處 首頁〈網址： http://www.acad.tku.edu.tw/index.asp/ 〉教務資訊「教學計畫 表管理系統」進入。 ※非法影印是違法的行為。請使用正版教科書，勿非法影印他人著作，以免觸法。	