

淡江大學 99 學年度第 2 學期課程教學計畫表

|  |  |          |                      |
|--|--|----------|----------------------|
| 課程名稱   | 資產管理   | 授課<br>教師 | 路祥琛<br>Cheung-sum Lu |
|  | ASSET MANAGEMENT   |          |                      |
| 開課系級   | 財金一碩士班 A   | 開課<br>資料 | 必修 單學期 3學分           |
|  | TBBMM1A  |          |                      |
| 學系(門)教育目標  |  |          |                      |
| 以完整進階的財務金融課程，培養具獨立分析、判斷與解決問題的財務專業人才。   |  |          |                      |
| 學生基本能力   |  |          |                      |
| <p>A. 培養進階財務金融理論的知識。</p> <p>B. 提升應用理論與實務技巧。</p> <p>C. 加強邏輯推演的能力。</p> <p>D. 財金研究方法的學習與運用。</p> <p>E. 具備表達、組織與應用能力。</p> <p>F. 強化學生溝通與解決問題的能力。</p> <p>G. 提升考取高階財金專業證照之能力。</p> <p>H. 具備學術未來深造的潛力。</p> |  |          |                      |
| 課程簡介   | 討論關於資產管理的議題。   |          |                      |
|  | In-depth discussions about managing assets in this ever-changing global economy. |          |                      |

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  | 資產管理的過程。     | The process of asset management. | P5   | ABE    |
| 2  | 各種管理資產組合的方式。 | Portfolios Management.           | P5   | ABEF   |
| 3  | 衡量資產管理的績效。   | Performance evaluation.          | A3   | ABEF   |

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  | 資產管理的過程。     | 課堂講授、分組討論 | 出席率、報告、討論、期末考 |
| 2  | 各種管理資產組合的方式。 | 課堂講授、分組討論 | 出席率、報告、討論、期末考 |
| 3  | 衡量資產管理的績效。   | 課堂講授、分組討論 | 出席率、報告、討論、期末考 |

授課進度表

| 週次 | 日期起訖                    | 內容 (Subject/Topics)                                      | 備註 |
|----|-------------------------|--|----|
| 1  | 100/02/14~<br>100/02/20 | Introduction   |    |
| 2  | 100/02/21~<br>100/02/27 | Market efficiency and modern portfolio theory - a review |    |
| 3  | 100/02/28~<br>100/03/06 | Setting portfolio objectives                             |    |
| 4  | 100/03/07~<br>100/03/13 | Statements of investment policy                          |    |
| 5  | 100/03/14~<br>100/03/20 | The asset allocation decision                            |    |

|              |                         |  |  |
|--------------|-------------------------|--|--|
| 6            | 100/03/21~<br>100/03/27 | Managing equity portfolio - equity style   | 3/22 Deadline to submit the discussion paper |
| 7            | 100/03/28~<br>100/04/03 | Managing equity portfolio - trading  |  |
| 8            | 100/04/04~<br>100/04/10 | Spring Break, NO CLASS   |  |
| 9            | 100/04/11~<br>100/04/17 | Managing equity portfolio - strategies   |  |
| 10           | 100/04/18~<br>100/04/24 | 期中考試週  |  |
| 11           | 100/04/25~<br>100/05/01 | Managing bond portfolio  |  |
| 12           | 100/05/02~<br>100/05/08 | Market timing  |  |
| 13           | 100/05/09~<br>100/05/15 | Managing individual investor portfolio   |  |
| 14           | 100/05/16~<br>100/05/22 | Managing institutional investor portfolio  |  |
| 15           | 100/05/23~<br>100/05/29 | Evaluation of performance  |  |
| 16           | 100/05/30~<br>100/06/05 | Behavior finance   |  |
| 17           | 100/06/06~<br>100/06/12 | Alternative asset types  |  |
| 18           | 100/06/13~<br>100/06/19 | 期末考試週  |  |
| 修課應<br>注意事項  |                         |  |  |
| 教學設備         |                         | 電腦、投影機   |  |
| 教材課本         |                         | 無  |  |
| 參考書籍         |                         | Investment Analysis and Portfolio Management, Eighth Edition - Reilly & Brown (South-Western).<br>Asset Management - Acharya (Wiley).<br>Portfolio Construction, Management, and Protection, Third Edition - Strong (South-Western). |  |
| 批改作業<br>篇數   |                         | 2 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<br>計算方式 |                         | ◆平時考成績：20.0 %    ◆期中考成績：        %    ◆期末考成績：35.0 %<br>◆作業成績： 45.0 %<br>◆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。**