

淡江大學 99 學年度第 2 學期課程教學計畫表

課程名稱	投資理財分析	授課 教師	莊忠柱 Chung-chu Chuang
	INVESTMENT AND FINANCIAL ANALYSIS		
開課系級	管科一碩士班 A	開課 資料	選修 單學期 3學分
	TMFXM1A		
學系(門)教育目標			
培育具備良好數理分析與邏輯判斷能力之中堅管理人才，以因應國內外企業之需要。			
學生基本能力			
<p>A. 培育具有決策分析課程學習之能力。</p> <p>B. 培育具有企業經營課程學習之能力。</p> <p>C. 培育具有統計分析課程學習之能力。</p> <p>D. 培育具有財經分析課程學習之能力。</p> <p>E. 培育具有科際整合之能力。</p> <p>F. 培育具有企業實務之能力。</p> <p>G. 具有外語運用能力。</p> <p>H. 具有學術論文競賽能力。</p>			
課程簡介	本課程將介紹投資報酬與風險的基本觀念、各種金融市場與工具、投資理論、投資組合理論，冀求給學生一個完整、有系統的思考架構，以厚植學生未來投資決策分析的能力。		
	This course introduces the elements of investment decision-making including the basic investment returns and risk concepts, various financial market and instruments, investment theory and portfolio theory. This course also gives student an integrated and systematic thinking framework and to raise the student with ability of investment decision-making in the future.		

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了解各種金融市場與工具	1 to see the various financial market and instruments.	C2	ABCD
2	2分析各種投資機會	2 to analyze the alternative investment opportunity.	P4	ABCD
3	3了解投資報酬與風險的抵換	3 to see the tradeoff between returns and risk of investment	C6	ABCD
4	4如何做好投資組合管理	4 How to manage a portfolio	A6	ABCD

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了解各種金融市場與工具	課堂講授	出席率、報告、討論
2	2分析各種投資機會	課堂講授、分組討論	出席率、報告
3	3了解投資報酬與風險的抵換	課堂講授、分組討論	出席率、報告、討論
4	4如何做好投資組合管理	課堂講授、分組討論	出席率、報告、討論

授課進度表

週次	日期起訖	內容 (Subject/Topics)	備註
1	100/02/14~ 100/02/20	Introduction	
2	100/02/21~ 100/02/27	How securities are traded?	
3	100/02/28~ 100/03/06	Learning about returns and risks from the historical record	
4	100/03/07~ 100/03/13	Risk aversion and capital allocation to risky assets	

5	100/03/14~ 100/03/20	Index model	
6	100/03/21~ 100/03/27	The capital asset pricing model	
7	100/03/28~ 100/04/03	The efficient market hypothesis	
8	100/04/04~ 100/04/10	Behavior finance and technical analysis	
9	100/04/11~ 100/04/17	Bonds price and yields	
10	100/04/18~ 100/04/24	The term structure of interest rates	
11	100/04/25~ 100/05/01	Macroeconomic and industry	
12	100/05/02~ 100/05/08	Equity valuation model	
13	100/05/09~ 100/05/15	Option markets: introduction	
14	100/05/16~ 100/05/22	Option valuation	
15	100/05/23~ 100/05/29	Futures, Swaps, and risk management	
16	100/05/30~ 100/06/05	Portfolio performance evaluation	
17	100/06/06~ 100/06/12	Hedge funds	
18	100/06/13~ 100/06/19	The theory of active portfolio management	
修課應 注意事項			
教學設備		電腦、投影機	
教材課本		Bodie, Z., A. Kane and A. J. Marcus, Investment, McGraw Hill, 2009.(華泰文化代理)	
參考書籍		Jordan, D. B. and Thomas W. Miller, Jr., Fundamentals of Investments: Valuations and Managements, McGraw Hill, 2009.	
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：30.0 % ◆期中考成績： % ◆期末考成績： % ◆作業成績： % ◆其他〈報告〉：70.0 %	

備考	<p>「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。</p> <p>※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。</p>
----	---