

淡江大學 99 學年度第 2 學期課程教學計畫表

課程名稱	投資組合管理	授課 教師	段昌文 Chang-wen Duan
	PORTFOLIO MANAGEMENT		
開課系級	財金一博士班 A	開課 資料	選修 單學期 3學分
	TBBMD1A		
學系(門)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。			
學生基本能力			
<p>A. 奠定紮實的財務金融理論基礎。</p> <p>B. 整合跨領域理論與實務的應用能力。</p> <p>C. 熟稔相關財金研究方法與成果。</p> <p>D. 具備獨立研究的學術能力。</p> <p>E. 培養金融環境的分析能力。</p> <p>F. 提升學生的教學素質。</p> <p>G. 提升學術研究國際化之能力。</p> <p>H. 強化學術研究團隊合作能力。</p>			
課程簡介	投資的風險與報酬抵換關係，效率的投資，資本資產定價模型推導，投資組合理論，投資組合的方法，市場投資組合因子的尋找，投資組合實證方式的應用，程式的撰寫。		
	The trade-off between risk and return, the efficiency of investment, derived to the capital asset pricing model, portfolio theory, application for portfolio approach, finding the factor to portfolio, and program code writing.		

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	投資組合理論	Portfolio Theory	C4	ADEF
2	實證方式的應用	Methodology for Empirical Study	P6	BC

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	投資組合理論	課堂講授、分組討論	出席率、報告、討論
2	實證方式的應用	分組討論	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	Risk and return	
3	100/02/28~ 100/03/06	Fundamentals of Portfolio	
4	100/03/07~ 100/03/13	Portfolio theory	
5	100/03/14~ 100/03/20	Advanced Portfolio	
6	100/03/21~ 100/03/27	Application to Portfolio	
7	100/03/28~ 100/04/03	Empirical Study on Portfolio 1	
8	100/04/04~ 100/04/10	Empirical Study on Portfolio 2	

9	100/04/11~ 100/04/17	CAPM 1	
10	100/04/18~ 100/04/24	CAPM 2	
11	100/04/25~ 100/05/01	Empirical Study on CAPM	
12	100/05/02~ 100/05/08	Program Code on Empirical Study	
13	100/05/09~ 100/05/15	Fama and Macbeth's empirical methodology I	
14	100/05/16~ 100/05/22	Fama and Macbeth's empirical methodology II	
15	100/05/23~ 100/05/29	Fama and French's empirical methodology I	
16	100/05/30~ 100/06/05	Fama and French's empirical methodology II	
17	100/06/06~ 100/06/12	Paper	
18	100/06/13~ 100/06/19	Final term paper	
修課應 注意事項			
教學設備		電腦、投影機	
教材課本		Portfolio Theory	
參考書籍			
批改作業 篇數		1 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： 70.0 % ◆其他〈 〉：        %	
備 考		「教學計畫表管理系統」網址： <a href="http://info.ais.tku.edu.tw/csp">http://info.ais.tku.edu.tw/csp</a> 或由教務處 首頁〈網址： <a href="http://www.acad.tku.edu.tw/index.asp/">http://www.acad.tku.edu.tw/index.asp/</a> 〉教務資訊「教學計畫 表管理系統」進入。 <b>※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。</b>	