

朝陽科技大學
101學年度第2學期教學大綱

當期課號	3019	中文科名	投資策略與管理
授課教師	塗勝傑	開課單位	財務金融系
學分數	3	修課時數	3
修習別	專業選修	開課班級	四年制3年級 A班
類別	一般課程		

本課程與系所培養學生核心能力關聯度	高度 關聯	中高 關聯	中度 關聯	中低 關聯	低度 關聯
應用財金專業知識與技能能力。	✓				
財金資訊與電腦操作能力。			✓		
實踐倫理道德與終身學習能力。			✓		
獨立思考與問題解決能力。		✓			
協調合作與溝通表達能力。				✓	

本課程培養學生下列知識：

本課程旨在培養學生對於投資組合的分析與管理能力，並且協助學生進行投資決策與績效評估。本課程之主要內容如下：1.投資程序與管理 2.認識風險與報酬 3.股票與債券市場 4.效率市場 5.基本分析與技術分析 6.投資組合管理 7.績效評估。

- 1.認識投資之過程、策略與管理之方法
- 2.認識投資風險與報酬間之關係
- 3.瞭解市場之效率性
- 4.瞭解如何管理投資組合
- 5.具備評估投資績效之能力

Approaches to Valuation/Risk and Return--Theory/Estimation of Discount Rates/Understanding Financial Statements/Estimation of Cashflows/Estimation of Growth Rates/Market Efficiency--Definition and Tests/Market Efficiency--The Evidence Dividend Discount Models/Free Cashflows to Equity Discount Models/Valuing a Firm--The Free Cashflows to the Firm Approach Special Cases in Discounted Cashflow Valuation/Price-Earnings Multiples/Price-Book Value Multiples/Price-Sales Multiples.

每週授課主題

- 第01週：投資程序與管理
- 第02週：認識風險與報酬
- 第03週：認識風險與報酬
- 第04週：股票與債券市場
- 第05週：效率市場
- 第06週：技術分析
- 第07週：基本分析
- 第08週：基本分析
- 第09週：期中考
- 第10週：股票評價
- 第11週：股票評價
- 第12週：轉換公司債市場
- 第13週：轉換公司債市場
- 第14週：投資組合管理
- 第15週：投資組合管理
- 第16週：投資績效評估
- 第17週：投資績效評估
- 第18週：期末考

成績及評量方式

平時作業及出席：30%
 期末考：40%
 期中考：30%

證照、國家考試及競賽關係

- 證券商高級業務員

主要教材

- 1.投資學原理-徐敬明 新陸書局(教科書)
- 2.財富管理--理論與實務(投資組合) 鄭義 新陸書局(教科書)

參考資料

本課程無參考資料!

建議先修課程

本課程無建議先修課程

教師資料

教師網頁：<http://www.cyut.edu.tw/~aaatooo/>

E-Mail：aaatooo@cyut.edu.tw

Office Hour：

分機：

[\[關閉\]](#) [\[列印\]](#)

尊重智慧財產權，請勿不法影印。