

**朝陽科技大學**  
**103學年度第1學期教學大綱**

當期課號	7568	中文科名	投資管理專題研究
授課教師	王言	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	碩士班2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
財金理論與實務專業之能力。		✓			
研究分析與規劃執行之能力。			✓		
倫理道德與社會責任之能力。			✓		
國際視野與外國語言之能力。		✓			

**本課程培養學生下列知識：**

本課程主要目的是讓同學了解投資組合的分析與管理能力，繼而對投資組合理論與實證做詳細的認知，隨後探討證券分析與資產定價以了解市場效率的重要性，進而介紹金融商品交易策略與評估、之後再藉由資產配置以了解理財規劃的重要性，最後探究投資人行為財務以規避錯誤投資決策。

- 1.熟悉投資組合理論與實證
- 2.熟悉市場效率性與證券分析
- 3.熟悉金融商品交易策略與評估
- 4.熟悉資產配置
- 5.熟悉行為財務

This course includes: 1. Approaches to Valuation/Risk and Return; 2. Theory/Estimation of Discount Rates/Understanding Financial Statements/Estimation of Cashflows/Estimation of Growth Rates; 3. Market Efficiency/Definition and Tests; 4. The Evidence Dividend Discount Models/Free Cashflows to Equity Discount Models/Valuing a Firm; 5. Portfolio management/Performance Evaluation.

**每週授課主題**

- 第01週：投資概論
- 第02週：時間價值
- 第03週：風險評估
- 第04週：實例討論
- 第05週：個案分析
- 第06週：總經分析
- 第07週：產業分析
- 第08週：財務分析
- 第09週：個案分析
- 第10週：期中報告
- 第11週：技術分析
- 第12週：技術分析
- 第13週：實例討論
- 第14週：投資商品
- 第15週：國際金融
- 第16週：國際財務
- 第17週：期末簡報
- 第18週：期末簡報

**成績及評量方式**

- 學習態度：20%
- 期中考：35%
- 口頭報告：10%
- 期末考：35%

**證照、國家考試及競賽關係**

本課程無證照、國家考試及競賽資料。

**主要教材**

- 1.財務管理概論, Financial Accounting(教科書)

## 2.Fundamentals of Investment(G.J. Alexander,etc)(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://lms.ctl.cyut.edu.tw/2005053>

E-Mail： [yalewang@cyut.edu.tw](mailto:yalewang@cyut.edu.tw)

Office Hour：

星期二,第2~3節,地點:T2-962;

星期四,第2~3節,地點:T2-962;

分機:

[\[關閉\]](#) [\[列印\]](#)

尊重智慧財產權，請勿不法影印。