

朝陽科技大學
104學年度第1學期教學大綱

當期課號	7571	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能力指標關聯度

核心能力	能力指標	高度 關聯	中 度 關 聯	低 度 關 聯
財金實務與經營管理能力。	財報分析及企業評價。		✓	
分析規劃與執行能力。	分析、研究各類型金融商品之市場資訊及未來趨勢，隨時掌握投資市場的脈動。			✓
倫理道德與社會責任能力。	描述公司治理與企業財務的關係。			✓
國際視野與終身學習能力。	使用國內外商情資料庫蒐集資料，並彙整及分析中英文相關文獻。			✓

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訂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

- 證券交易分析人員
- 證券商業務員

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)
- 3.王言(自製教材)

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

Office Hour：

星期二,第5~6節,地點:T2-962;

星期三,第1~2節,地點:T2-962;

分機:4608

[\[關閉\]](#) [\[列印\]](#)

尊重智慧財產權，請勿不法影印。