

朝陽科技大學
105學年度第2學期教學大綱

當期課號	7017	中文科名	基金管理專題
授課教師	方世詮	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	日間部碩士班1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	關聯度		
		高度關聯	中度關聯	低度關聯
財金理論與實務專業之能力。	提供貴賓級客戶理財規劃分析及境外資產管理。		✓	
財金理論與實務專業之能力。	承銷、報價有價證券。			✓
研究分析與規劃執行之能力。	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。	✓		
國際視野與外國語言之能力。	撰寫中英文書面報告及進行口頭簡報。			✓

本課程培養學生下列知識：

基金管理專題主要目的在於了解基金市場之架構與運作，廣義的基金市場包含共同基金、避險基金、退休基金、不動產基金等？除了研究基金市場架構、基金商品種類、基金設計原理、基金特殊條款外，並分析基金經理人管理行為與操作策略，以及進而研究上述行為與基金市場之交互影響。

1. 認識法人投資的理論基礎
2. 認識法人投資的業務範圍
3. 認識共同基金的產業概況
4. 認識避險基金的產業概況
5. 認識經理人之行為與策略

This course will deliver fundamental understanding for fund market, including mutual fund, hedge fund, and pension fund etc. In addition to fund market structure, instruments, design rules, and special provisions, we also cover the management behavior and investment strategy for fund managers and its relationship with fund markets.

每週授課主題

- 第01週：課程簡介。本學期課程安排與內容規劃。
- 第02週：投資組合理論 I
- 第03週：投資組合理論 II
- 第04週：投資組合理論 III
- 第05週：法人投資 I
- 第06週：法人投資 II
- 第07週：資產配置 I
- 第08週：資產配置 II
- 第09週：期中考
- 第10週：共同基金 I
- 第11週：共同基金 II
- 第12週：退休基金 I
- 第13週：退休基金 II
- 第14週：套利基金 I
- 第15週：套利基金 II
- 第16週：創投基金 I
- 第17週：創投基金 II
- 第18週：期末考

成績及評量方式

口頭報告：40%
平時作業及出席：60%

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. Modern Portfolio Theory and Investment Analysis Edwin J. Elton etc Wiley 9780470505847 2011 (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/2001092>

E-Mail：phfang@cyut.edu.tw

Office Hour：

星期一,第3~4節,地點:L-706;

星期三,第3~4節,地點:L-706;

分機:4320

[\[關閉\]](#) [\[列印\]](#)

尊重智慧財產權，請勿不法影印。