

朝陽科技大學  
107學年度第2學期教學大綱

當期課號	1074	中文科名	投資策略與管理
授課教師	李瑞琳	開課單位	財務金融系
學分數	3	修課時數	3
		開課班級	日間部四年制3年級 A班
修習別	專業選修		
類別	一般課程		

**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：投資過程、策略與管理
- 第02週：投資風險與報酬間關係
- 第03週：市場效率性
- 第04週：投資組合管理
- 第05週：專業股票篩選-基本屬性
- 第06週：專業股票篩選-股價判斷因子
- 第07週：專業股票篩選-財務判斷因子
- 第08週：專業股票篩選-董監事與信用平等
- 第09週：期中考
- 第10週：技術分析-型態學
- 第11週：技術分析-指標學
- 第12週：技術分析-趨勢
- 第13週：分組報告
- 第14週：分組報告
- 第15週：分組報告
- 第16週：分組報告
- 第17週：分組報告
- 第18週：期末考

**成績及評量方式**

- 平時作業及出席：10%  
期中考：30%  
期末報告：50%  
隨堂模擬測驗：10%

**證照、國家考試及競賽關係**

- 證券商高級業務員

**主要教材**

- 1.小散戶這樣追籌碼賺1億 麥克連Smart智富 97898672836102015/06/27(教科書)
- 2.買對強勢股，讓你提早退休20年：不只是賺，還要賺很快，賺很多 張真卿財經傳訊97898613021712015-07-31(教科書)
- 3.計量價值的勝率：結合愛德華索普計量交易與巴菲特價值投資的新藍海策略譯者：黃嘉斌寰宇出版社97898683194172018/11/19(教科書)
- 4.追籌碼賺1億(2)：麥克連教你挑選會飆的法人認養股 麥克連Smart智富 97898672837882016/11/09(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/~rlee/>

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

Office Hour：

星期二,第3~4節,地點:L-705;

星期三,第3~4節,地點:L-705;

分機:7091、4490

[\[關閉\]](#) [\[列印\]](#)

尊重智慧財產權，請勿不法影印。