

朝陽科技大學  
109學年度第2學期教學大綱

當期課號	1077	中文科名	投資策略與管理
授課教師	張世昌	開課單位	財務金融系
學分數	2	修課時數	2
		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

Investment Strategies and Management is the art of putting together and managing various investments to meet specific goals. We will examine management strategy choices, asset allocation and investing strategies, and management of risk as they pertain to management of an investment portfolio. This course includes some fields, as following: 1. investment procedures and management 2. understanding of risks and rewards 3. stock and bond markets 4. efficiency markets 5. basic and technical analysis 6. portfolio management 7. performance evaluation

**每週授課主題**

- 第01週：資產配置概論
- 第02週：投資風險與報酬間之關係
- 第03週：效率市場與資訊取得
- 第04週：如何擬定投資策略
- 第05週：評估投資績效
- 第06週：管理投資組合
- 第07週：程式選股1
- 第08週：程式選股2
- 第09週：期中報告
- 第10週：深入探討投資風險與投資心理之關係
- 第11週：投資策略商品選擇1股票
- 第12週：投資策略商品選擇2債券
- 第13週：投資策略商品選擇3基金
- 第14週：投資策略商品選擇4保險
- 第15週：投資策略商品選擇5衍生性金融商品
- 第16週：策略移轉與績效評估
- 第17週：策略管理與投資心理之關係
- 第18週：期末報告

**成績及評量方式**

平時：30%  
期中報告：30%  
期末報告：40%

**證照、國家考試及競賽關係**

- 證券商高級業務員

**主要教材**

- 1.老師自行整理之投資策略精華檔案(自製教材)

**參考資料**

本課程無參考資料!

**建議先修課程**

- 1.金融市場、會計學、投資學

## 教師資料

教師網頁：<http://www.cyut.edu.tw/~wish3362/>

E-Mail：[wish3362@cyut.edu.tw](mailto:wish3362@cyut.edu.tw)

Office Hour：

分機：

[\[關閉\]](#) [\[列印\]](#)

尊重智慧財產權，請勿不法影印。