

朝陽科技大學  
110學年度第2學期教學大綱

當期課號	1078	中文科名	投資策略與管理
授課教師	簡司凱	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：課程介紹
- 第02週：資產配置
- 第03週：資產配置
- 第04週：資產配置
- 第05週：交易策略開發
- 第06週：交易策略開發
- 第07週：共同基金投資管理
- 第08週：共同基金投資管理
- 第09週：期中考
- 第10週：金融就業市場分析
- 第11週：技術分析實戰
- 第12週：技術分析實戰
- 第13週：技術分析實戰
- 第14週：美股交易市場介紹
- 第15週：總體經濟分析
- 第16週：總體經濟分析
- 第17週：投資心理學
- 第18週：期末考

**成績及評量方式**

上課出席率：25%  
期中考：25%  
期末考：25%  
報告成績：25%

**證照、國家考試及競賽關係**

- 證券商高級業務員

**主要教材**

- 1.趨勢交易 Thomas K.Carr 寰宇出版社 978-986-157-850-720121(教科書)

**參考資料**

- 書名：機械化交易新解 作者：Parkson 出版年(西元)：2011 出版社：寰宇出版社  
書名：交易創造自己的聖盃 作者：Van K.Tharp 出版年(西元)：2010 出版社：麥格羅希爾  
書名：交易策略評估與最佳化 作者：Robert Pardo 出版年(西元)：2010 出版社：寰宇出版社  
書名：計量交易 作者：ERNEST P.CHAN 出版年(西元)：2011 出版社：寰宇出版社  
書名：哈佛耶魯教你一輩子的理財規劃 作者：Mebane T.Faber 出版年(西元)：2009 出版社：財信出版社

書名：經濟指標告訴你&沒告你的事 作者：Izaax 出版年(西元)：2012 出版社：Smart智富  
書名：活用五線譜 漲跌都能賺 作者：薛兆亨、Tivo168 出版年(西元)：2018 出版社：Money錢

#### 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/~kevin032612345/>

E-Mail：[kevin032612345@gmail.com.tw](mailto:kevin032612345@gmail.com.tw)

Office Hour：

分機：

[\[關閉\]](#) [\[列印\]](#)

尊重智慧財產權，請勿不法影印。