

朝陽科技大學  
112學年度第1學期教學大綱

當期課號	7016	中文科名	避險基金專題
授課教師	方世詮	開課單位	財務金融系
學分數	2	修課時數	2
		開課班級	日間部碩士班1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：**

本課程旨在探討避險基金市場之原理與理論，分析避險基金市場與經濟體系之間的關係，研究避險基金市場在遭遇各種事件時的反應與調整，並及於與各類金融市場之間的互動，並探究避險基金市場未來之發展趨勢。

- 1.了解避險基金市場之概況
- 2.了解避險基金市場之運作邏輯
- 3.了解避險基金市場與經濟體系之間的關係
- 4.了解避險基金市場面對各種事件之反應模式
- 5.了解避險基金市場與各類金融市場之間的互動
- 6.了解避險基金市場未來發展趨勢

We deliver the basic principle and fundamental theory of the hedge fund markets in this course. To analysis the relationship between the hedge fund markets and the economy systems and investigate the reaction of the hedge fund markets while facing various shocking events. Moreover, we include the topics of interaction among financial markets and the emerging trend of hedge 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：R 語言簡介
- 第03週：R 語言程式 I
- 第04週：R 語言程式 II
- 第05週：投資組合理論
- 第06週：資產定價模型
- 第07週：投資組合建構
- 第08週：投資組合指數化
- 第09週：期中考
- 第10週：資產配置
- 第11週：全球資產配置
- 第12週：資產配置投資組合
- 第13週：風險指標 I
- 第14週：風險指標 II
- 第15週：風險調整報酬 I
- 第16週：風險調整報酬 II
- 第17週：期末考
- 第18週：債券資產類別 / 非同步線上課程

**成績及評量方式**

- 平時作業：60%
- 出席：10%
- 期中作業：15%
- 期末作業：15%

**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 8(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/~phfang/>

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

Office Hour：

星期三,第3~4節,地點:L-706;

星期四,第5~6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。