

南台科技大學 98 學年度第 2 期課程資訊

課程名稱	投資組合管理
課程編碼	70P13301
系所代碼	07
開課班級	專四技企管三甲
開課教師	楊雪蘭
學分	3.0
時數	3
上課節次地點	二 11 12 13 教室 E0409
必選修	選修
課程概述	本課程重點在協助同學看懂金融市場相關的報章雜誌，以便日後自行投資，僅涉及少量計算。
課程目標	建立台灣本土金融市場與各項金融投資工具的基本認識，並納入資本資產定價模式相關之證券投資組合理論；注重股票之基本分析與技術分析兩套技術，以便同學將來自行投資之用。
課程大綱	<p>先簡介台灣本土之金融市場與各項金融投資工具 (CH2&3)，建構投資基礎。再講投資資本資產定價模式相關之證券投資組合理論 (CH12)。在投資實務上，股票分析工作大致可分為基本分析與技術分析兩套方式，「基本分析」包含政經分析 (CH14)、產業分析 (CH15) 與公司分析 (CH16) 三者，是本課程的主題；「技術分析」(CH17) 包含道式、波浪與 K 線理論、KD 值、相對強弱指標、乖離率、趨向指標、MACD 等，均在本課程教導範圍之內。</p> <p>平時成績分兩部分：(1)各組每位同學期末書面作業上台報告的表現評分 (從第 15 週 5/28 開始，至第 17 週 6/11 為止，共計 3 週上台報告，平均每週 3 組)，加上(2)出席分數 (80 分為基準，缺曠每堂扣壹分，全勤加 5 分)；4/16 期中考 (OPEN BOOK 考試)，範圍是 CH2、CH3 與 CH12，以選擇題為主；期末繳交乙份分組報告 (約 10 頁)，題目是小組的投資計畫，請選定 CH2&3 中某一項金融商品，若是基金，請運用 CH12 相關知識分析 (相關網站：基智網、鉅亨網、中華民國投信投顧公會)；若是股票，請運用 CH14~17 相關知識分析 (相關網站：雅虎財經、行政院金融監督管理委員會-證券期貨局、TSEC 台灣證券交易所、PChome 股市、MSN 台灣理財)，期末不進行筆試，以小組書面報告評分。</p>
英文大綱	<ol style="list-style-type: none"> 1. Understanding Investments 2. Stocks and Bonds 3. Assets Securitization and Derivative Financial Products 4. CAPM Theory 5. Economy/ Market Analysis 6. Industry Analysis

	7. Company Analysis 8. Technical Analysis
教學方式	課堂教授,分組討論,口頭報告,實務操作,
評量方法	自行設計測驗,作業／習題練習,實作評量,口頭報告,課堂討論,課程參與度(出席率),
指定用書	投資學—基本理論與實務，三版，ISBN：978-957-41-6040-2
參考書籍	徐俊明<<投資學原理>>第五版，2007，新陸書局，ISBN：978-986-7260-51-2 Bodie, Kane and Marcus (2009), Investments, 8th ed., New York: McGraw-Hill. 華泰文化代理，ISBN-13：978007126325 投資學—學習指南與題庫（2009），證券基金會叢書，五南書局代理，ISBN：9789866684319
先修科目	
教學資源	講義、投影片、報章雜誌相關報導、試用輔助投資電腦程式 基金相關網站：基智網、鉅亨網、中華民國投信投顧公會； 股票相關網站：雅虎財經、行政院金融監督管理委員會-證券期貨局、TSEC 台灣證券交易所、PChome 股市、MSN 台灣理財
注意事項	出席率、學習態度
全程外語授課	0
授課語言 1	華語
授課語言 2	
輔導考照 1	證券營業員
輔導考照 2	理財規劃人員專業能力測驗