

# 南臺科技大學 107 學年度第 2 學期課程資訊

|                |  |
|----------------|--|
| 課程代碼           | 80M00501   |
| 課程中文名稱         | 投資理論與策略  |
| 課程英文名稱         | Investment:Theory and Strategy   |
| 學分數            | 3.0  |
| 必選修            | 必修   |
| 開課班級           | 碩研財金一甲   |
| 任課教師           | 朱曉洪  |
| 上課教室(時間)       | 週二第 7 節(S404)<br>週二第 8 節(S404)<br>週二第 9 節(S404)  |
| 課程時數           | 3  |
| 實習時數           | 0  |
| 授課語言 1         | 華語   |
| 授課語言 2         |  |
| 輔導考照 1         | CFA  |
| 輔導考照 2         | CFP  |
| 課程概述           | This course will help you become an informed practitioner of investments, and provide you with background in the organization of various securities markets..  |
| 先修科目或預備能力      |  |
| 課程學習目標與核心能力之對應 |  |
| 中文課程大綱         | <ol style="list-style-type: none"> <li>1. 投資環境介紹.</li> <li>2. 證券市場交易</li> <li>3. 共同基金和其他投資機構</li> <li>4. 投資組合理論</li> <li>5. 最適投資組合</li> <li>6. 資本資產定價模式</li> <li>7. 效率市場實證</li> <li>8. 行為財務學</li> <li>9. 投資組合評價</li> <li>10. 國際投資組合</li> </ol> |
| 英/日文課程大綱       | <ol style="list-style-type: none"> <li>I. The Investment Enviornment</li> <li>II. How Securities are Traded</li> <li>III. Mutual Fund and other Investment Company</li> </ol>  |

|               |  |
|---------------|--|
|               | IV. Capital Asset Allocation<br>V. Optimal Risky portfolio<br>VI. The Capital Asset Pricing Model<br>VII. The Efficient Market Hypothesis<br>VIII. Behavior Finance and Technical Analysis<br>IX. Portfolio Performance Evaluation<br>X. International Diversification |
| 課程進度表         | 1-2 證券投資分析概念<br>3-4 投資組合理論與效率市場<br>5 證券之評價與分析<br>6-7 總體經濟與產業分析<br>8 期中考<br>9-10 股票投資技術<br>11-12 投資組合管理<br>13-14 衍生性金融商品<br>15 國際金融<br>16 期末考   |
| 教學方式與評量<br>方法 |  |
| 指定用書          | 書名：投資學:理論與實務<br>作者：林哲鵬,葉智丞 譯<br>書局：McGraw Hill Education<br>年份：2018<br>ISBN：9789863413981<br>版本：11   |
| 參考書籍          |  |
| 教學軟體          |  |
| 課程規範          |  |