

1002學期 課程基本資料/Course Information

系所 / 年級	財金系 4年級	課號 / 班別	86U00168 / A
學分數	3學分	選 / 必修	選修
科目中文名稱	投資管理專題	科目英文名稱	Topics in Investment Management
主要授課老師	張俊評	開課期間	一學年之下學期
人數上限	104 人	已選人數	102人

起始週 / 結束週 / 上課地點 / 上課時間

第1週 / 第18週 / M004 / 星期1第98節
 第1週 / 第18週 / M004 / 星期1第05節
 第1週 / 第18週 / M004 / 星期1第06節

請各位同學遵守智慧財產權觀念；請勿非法影印。
 Please observe Intellectual Property Rights (IPR), not to make illegal copies.

教學綱要/syllabus

第一部分/Part I(※依課程委員會審議之內容決議填入)

	基本素養/核心能力 Core Literacy/Core Competencies	相關性 Relevance	
		高度相關	中度相關
一、教學目標所要達成之能力培養項目： 【依據課程委員會審議通過之課程與基本素養/核心能力關聯表填寫】	職業倫理	.	<input type="checkbox"/>
	合作創新	<input type="checkbox"/>	.
	資訊分析	.	<input type="checkbox"/>
	溝通協調	.	<input type="checkbox"/>
	財金專業	<input type="checkbox"/>	.

- 二、教學目標 (Objective)
- 1.認知面：【使學生理解、應用、分析、綜合、比較、推論、評估本課程之理論與概念】：
風險-報酬的抵換,資產配置歸因理論,績效評估
 - 2.技能面【使學生能獲得運用與實做本課程理論與概念之技巧】：
馬可維茲的平均值-變異數方法,CAPM
 - 3.情意面【能引發學生對本課程之興趣，激發學生學習動機，增加觸類旁通與自主學習】：
如何利用指標來使投資價值最大化,以致於到個人投資配置

三、符合教學目標之課程內容設計
 風險與報酬,效用-風險-報酬,資本配置線,績效評估,期間結構

四、先修科目 (Pre Course)
 投資學

第二部分/Part II

- 一、多元教學方法 (Teaching Method)
- | | | |
|--|--|--|
| <input type="checkbox"/> 由學生自訂學習目標與抱負水準 | <input type="checkbox"/> 案例或故事討論 | <input checked="" type="checkbox"/> 講述 |
| <input type="checkbox"/> 服務學習 | <input checked="" type="checkbox"/> 學生課後書面報告 | <input type="checkbox"/> 參訪 |
| <input type="checkbox"/> 學生上台報告 | <input checked="" type="checkbox"/> 腦力激盪 | <input type="checkbox"/> 角色演練 |
| <input checked="" type="checkbox"/> 習題練習 | <input type="checkbox"/> 影片欣賞與討論 | <input type="checkbox"/> e化教學 |
| <input type="checkbox"/> 審議式民主 | <input type="checkbox"/> 觀察與資料收集 | <input type="checkbox"/> 其他 |
| | <input type="checkbox"/> 小組討論 | |
| | <input type="checkbox"/> 學生實作 | |
| | <input type="checkbox"/> 採訪 | |
| | <input checked="" type="checkbox"/> 一分鐘回饋 | |

二、參考書目 (Reference)

【符合教學目標之參考書目】 Bodie et al., Investments, International edition

2012/2/6	十七、 International Diversification	張俊評
2012/2/20	十六、 Futures, Swaps, and Risk Management	張俊評
2012/2/27	十五、 Futures Markets	張俊評
2012/3/5	十四、 Options Markets: Introduction	張俊評
2012/3/12	十三、 Equity Valuation Models	張俊評
2012/3/19	十二、 The Term Structure of Interest Rates	張俊評
2012/3/26	十一、 Bond Prices and Yields	張俊評
2012/4/2	十、 Empirical Evidence on Security Returns	張俊評
2012/4/9	九、 Behavioral Finance and Technical Analysis	張俊評
2012/4/16	八、 The Efficient Market Hypothesis	張俊評
2012/4/23	七、 Arbitrage Pricing Theory and Multifactor Models of Risk and Return	張俊評
2012/4/30	六、 The Capital Asset Pricing Model	張俊評
2012/5/7	五、 Index Model	張俊評
2012/5/14	四、 Portfolio Performance Evaluation	張俊評
2012/5/21	三、 Optimal Risky Portfolios	張俊評
2012/5/28	二、 Risk Aversion and Capital Allocation to Risky Assets	張俊評
2012/6/4	一、 Learning About Return and Risk from the Historical Record	張俊評 張俊評 張俊評 張俊評 張俊評 張俊評 張俊評

評量方式	分數	評量方式	分數
<input type="checkbox"/> 實作測驗	0	<input checked="" type="checkbox"/> 期中筆試	20
<input type="checkbox"/> 隨堂筆試測驗	0	<input type="checkbox"/> 期末筆試	0
<input type="checkbox"/> 小組作業	0	<input checked="" type="checkbox"/> 期中報告	30
<input type="checkbox"/> 服務日誌	0	<input checked="" type="checkbox"/> 期末報告	30
<input type="checkbox"/> 口試	0	<input type="checkbox"/> 專題報告	0
<input checked="" type="checkbox"/> 個人上台報告	20	<input type="checkbox"/> 實作作品與反思	0
<input type="checkbox"/> 小組上台報告	0	<input type="checkbox"/> 前後測比較進步與成長	0
<input type="checkbox"/> 出席狀況	0	<input type="checkbox"/> 課堂參與與表現	0
<input type="checkbox"/> 心得與反思報告	0	<input type="checkbox"/> 其他	0

五、講義位址 (http://)

[回上頁](#) [重新查詢](#)