

## 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 / C
學分數	3學分	選 / 必修	必修
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	林哲鵬	開課期間	一學年之下學期
人數上限	8人	已選人數	8人

## 起始週 / 結束週 / 上課地點 / 上課時間

第1週 / 第18週 / M416 / 星期1第06節  
 第1週 / 第18週 / M416 / 星期1第07節  
 第1週 / 第18週 / M416 / 星期1第08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"/>	.

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]：

This course focuses on the knowledge in the field of investment and emphasizes the theory behind investment instruments, portfolio management, market efficiency and market anomalies.

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]：

During the class, we will discuss various asset classes and financial instruments include: bonds, stocks, mutual funds and options. Contents related to modern financial theory will be introduced include: risk and return, efficient diversification, CAPM&APT, efficient market hypothesis, market anomalies and behavioral finance.

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]：

Students who take this course are expected to: 1.read chapters assigned in the class; 2.present chapters guidelines alone with related news topics or academic issues 3.discuss in class and do homework after class; and 4.find a research topic before midterm and complete a research paper in the end of the semester.

Weekly Course Design: ( 1 ): Overview and Introduction. ( 2 ): Bond Market, Price and Yield ( 3 ):

Stock Market ( 4 ): Equity Valuation ( 5 ): Mutual Funds and Other Investment Companies ( 6 ):

三、符合教學目標 Midterm Exam Week (work on term paper) (7): Asset Classes and Financial Instruments (8):

四、先修科目  
(Pre Course)

Undergraduate level: economics, accounting, statistics, financial management

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 checked="" type="checkbox"/> 學生上台報告 | <input checked="" type="checkbox"/> 腦力激盪     | <input checked="" type="checkbox"/> 角色演練 |
| <input type="checkbox"/> 習題練習              | <input type="checkbox"/> 影片欣賞與討論             | <input checked="" 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"/> 學生實作                |  |
|  | <input type="checkbox"/> 採訪                  |  |
|  | <input type="checkbox"/> 一分鐘回饋               |  |

二、參考書目  
(Reference)

Essentials of Investments 8th ed. International Edition/ 2010/ Bodie, Kane and Marcus/ Published by McGraw Hill/ISBN 978-0-07-338240-1

[符合教學目標之參考書目]

2012/2/20	Overview and Introduction.	林哲鵬
2012/2/27	National Holiday - Peace Memorial Day	林哲鵬
2012/3/5	Bond Market, Price and Yield	林哲鵬
2012/3/12	Stock Market and Equity Valuation	林哲鵬
2012/3/19	Mutual Funds and Other Investment Companies	林哲鵬
2012/3/26	Options Markets	林哲鵬
2012/4/2	Options Valuation	林哲鵬
2012/4/9	Risk and Return / Efficient Diversification	林哲鵬
2012/4/16	Midterm Exam Week	林哲鵬
2012/4/23	The Efficient Market Hypothesis	林哲鵬
2012/4/30	Issues on Behavioral Finance	林哲鵬
2012/5/7	Academic Literature Review: Market Efficiency and Anomalies	林哲鵬
2012/5/14	Academic Literature Review: Event Study, Momentum, Overreaction	林哲鵬
2012/5/21	Due for term papers and Presentation PPT	林哲鵬

三、教學進度  
(Syllabi)

[符合教學目標之教學進度]

四、多元評量方法  
(Evaluation)

[所勾選評量方法之評分加總為100分]

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	30
<input checked="" type="checkbox"/> 隨堂筆試測驗	10	<input type="checkbox"/> 期末筆試	0
<input checked="" type="checkbox"/> 小組作業	10	<input type="checkbox"/> 期中報告	0
<input type="checkbox"/> 服務日誌	0	<input checked="" type="checkbox"/> 期末報告	20
<input type="checkbox"/> 口試	0	<input type="checkbox"/> 專題報告	0
<input checked="" type="checkbox"/> 個人上台報告	10	<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 checked="" type="checkbox"/> 出席狀況	10	<input checked="" type="checkbox"/> 課堂參與與表現	10
<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](#)