

重新查詢

友善列印

### 0981學期 課程基本資料

系所 / 年級	財金系 4年級	課號 / 班別	86U00144 / A
學分數	3學分	選 / 必修	選修
科目中文名稱	投資組合分析	科目英文名稱	Investment Portfolio Analysis
主要授課老師	陳獻儀	開課期間	一學年之上學期
人數上限	61 人	已選人數	46人

### 起始週 / 結束週 / 上課地點 / 上課時間

第1週 / 第18週 / M012 / 星期3第02節  
第1週 / 第18週 / M012 / 星期3第03節  
第1週 / 第18週 / M012 / 星期3第04節

請各位同學遵守智慧財產權觀念；請勿非法影印。

### 教學綱要

- 一、教學目標(Objective) 1.認識現代投資組合理論。 2.熟悉各類投資工具組合之交易策略，包括避險、套利與價差策略等。
- 二、先修科目(Pre Course) 投資學
- 三、教材內容(Outline) 1.投資組合分析概論 2.證券分析 3.投資組合管理基本概念 4.投資組合管理決策過程 5.現代投資組合理論
- 四、教學方式(Teaching Method) PPT課堂講授
- 五、參考書目(Reference) 課堂宣布

2009/9/16 課程簡介  
2009/9/23 理財規劃基本概念  
2009/9/30 投資目標設定  
2009/10/7 經濟觀念的概論  
2009/10/14 經濟觀念的應用  
2009/10/21 資產配置(一)  
2009/10/28 資產配置(二)  
2009/11/4 小考

陳獻儀

六、教學進度(Syllabi)

2009/11/11 期中考  
2009/11/18 共同基金與投資組合績效評估(一)  
2009/11/25 共同基金與投資組合績效評估(二)  
2009/12/2 投資組合調整  
2009/12/9 股票評價與股票投資組合管理  
2009/12/16 債券評價與債券投資組合管理  
2009/12/23 衍生性金融商品  
2009/12/30 國際財務管理與匯率平價關係  
2010/1/6 複習  
2010/1/13 期末考

七、評量方式(Evaluation)

筆試 個案報告 期中成績35% 期末成績35% 平時成績 30%

八、講義位址(<http://>)

九、教育目標

重新查詢