

100-1 大葉大學 完整版課綱

基本資訊

課程名稱	投資組合管理	科目序號 / 代號	2945 / GMN6020
開課系所	管理學院碩士在職專班	學制 / 班級	碩士在職專班1年1班
任課教師	陳玉芬	專兼任別	專任
必選修 / 學分數	選修 / 3	畢業班 / 非畢業班	非畢業班
上課時段 / 地點	(二)ABC / B002	授課語言別	中文

課程簡介

結合投資組合理論與資產配置實務,建立學生理論基礎與實務應用能力,以期應用於個人理財與企業理財。

課程大綱

投資組合理論
 投資組合分析與選擇
 金融商品分析與評價
 (債券,股票,共同基金,外匯
 商品市場,期貨市場)

基本能力或先修課程

財務管理,投資學

課程與系所基本素養及核心能力之關連

-  解決問題能力
-  溝通能力
-  倫理觀
-  專業能力

教學計畫表

系所核心能力	權重(%) 【A】	檢核能力指標(績效指 標)	教學策略	評量方法及配分 權重	核心能力 學習成績 【B】	期末學習 成績 【C=B*A 】
--------	--------------	------------------	------	---------------	---------------------	---------------------------

解決問題能力	20%	解決問題能力	講述法 學生上台報告	課程參與度: 40% 口頭報告: 30% 書面報告: 30%	加總: 100	20
溝通能力	10%	溝通能力	講述法 學生上台報告	課程參與度: 40% 口頭報告: 30% 書面報告: 30%	加總: 100	10
倫理觀	15%	倫理觀	講述法 學生上台報告	課程參與度: 40% 口頭報告: 30% 書面報告: 30%	加總: 100	15
專業能力	55%	專業能力	講述法 學生上台報告	課程參與度: 40% 口頭報告: 30% 書面報告: 30%	加總: 100	55

成績稽核

課程參與度: 40%

口頭報告: 30%

書面報告: 30%

教科書(尊重智慧財產權，請用正版教科書，勿非法影印他人著作)

書名	作者	譯者	出版社	出版年
無參考教科書				

參考教材及專業期刊導讀(尊重智慧財產權，請用正版教科書，勿非法影印他人著作)

書名	作者	譯者	出版社	出版年
Modern Portfolio Theory and Investment Analysis	Elton, Gruber, Brown and Goetzmann		John Wiley & Sons	2011

上課進度

週次	教學內容	分配時數(%)				
		講授	示範	習作	實驗	其他
1	課程簡介	100	0	0	0	0
2	投資組合理論(I)	100	0	0	0	0
3	投資組合理論(II)	50	50	0	0	0
4	投資組合理論(III)	50	50	0	0	0
5	債券市場分析與評價	100	0	0	0	0
6	股票市場分析與評價	100	0	0	0	0
7	股票市場技術分析	100	0	0	0	0
8	共同基金市場分析(I)	100	0	0	0	0
9	期中考	0	0	0	0	100
10	共同基金市場分析(I)	100	0	0	0	0

11	外匯市場分析與評價	100	0	0	0	0
12	商品市場分析與評價	100	0	0	0	0
13	期貨市場分析與評價(I)	100	0	0	0	0
14	期貨市場分析與評價(II)	100	0	0	0	0
15	投資組合分析與選擇(I)	100	0	0	0	0
16	投資組合分析與選擇(I)	50	50	0	0	0
17	投資組合分析與選擇(I)	50	50	0	0	0
18	期末考	0	0	0	0	100
