

101-1 大葉大學 完整版課綱

基本資訊

課程名稱	投資組合分析	科目序號 / 代號	2893 / FBM3026
開課系所	財務金融學系	學制 / 班級	大學日間部3年1班
任課教師	張椿柏	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	(四)234 / B204	授課語言別	中文

課程簡介

A.管理學院SQ (Society Quotient ; 社會智商) 核心能力之四大構面(SCEP) :

- 1.S-解決問題能力 (洞析力、決策力、執行力)
- 2.C-溝通能力 (傾聽能力、表達能力)
- 3.E-倫理觀 (社會倫理、企業倫理、研究倫理)
- 4.P-專業能力 (管理能力-強調商管知識與技能、研究能力-強調商管研究專業)

B.財務金融系之教育目標

本系教育目標 (WE CARE)在於厚植學生職場之專業財金技能 (W) , 使其具備主動探索與善於溝通的人格特質 (E) , 以及運用財金資訊與分析的能力 (CA) , 進而成為富有責任感與倫理觀 (RE) 之財金專業人才 , 而為企業所樂於雇用。

C.財務金融系之核心能力 : [占課程之比重]

- A1. 「具備財金專業能力與國際視野」 [58%]
- A2. 「能透過合作溝通與創新思考, 主動發掘並解決問題」 [8%]
- A3. 「擁有財金資訊蒐集、整合與分析應用之能力」 [28%]
- A4. 「具有責任與倫理素養並願意關懷社會」 [6%]

D.課程描述 :

本課程的主要目的即在讓學生瞭解投資理財的基本概念, 各類金融資產之性質, 並介紹台灣證券市場的制度、實務等知識。讓學生從本課程中習得研判各種市場狀況、產業前景、個別企業的營運與財務狀況等的的能力, 課程中並安排投資組合模擬練習及競賽。希望能激起學生的興趣, 並能將正確的投資理財觀念應用於現實生活中。

E.可報考的金融證照

修習本課程後, 可以報考證券商業務員、證券商高級業務員、投信投顧業務員以及投資型保險業務員等金融證照。

課程大綱

本課程主要是讓同學瞭解各種金融投資工具之屬性, 介紹各種投資工具之報酬與風險的衡量方式, 而且在量化的架構下形成最適投資組合, 並依據系核心能力: 「具備商業、管理與財金專業能力與國際視野 (A1

)」、「能透過合作溝通與創新思考，主動發掘與解決問題(A2)」、「擁有財金資訊蒐集、整合與分析應用之能力(A3)」及「具有責任與倫理素養，願意關懷社會(A4)」，計劃於每一週培養之核心能力分述如下：

第一週 (A1、 A2、 A3、 A4)

第二週 (A1、 A2、 A3、 A4)

第三週 (A1、 A2、 A3)

第四週 (A1、 A2、 A3)

第五週 (A1、 A2、 A3)

第六週 (A1、 A2、 A3)

第七週 (A1、 A2、 A3)

第八週 (A1、 A3)

第九週 (A1、 A2、 A3)

第十週 (A1、 A2、 A3)

第十一週 (A1、 A2、 A3)

第十二週 (A1、 A2、 A3、 A4)

第十三週 (A1、 A2、 A3、 A4)

第十四週 (A1、 A2、 A3)

第十五週 (A1、 A2、 A3)

第十六週 (A1、 A2、 A3)

第十七週 (A1、 A2、 A3)

第十八週 (A1、 A3)

(教學大綱視學習狀況、及資料庫說明會調整)

基本能力或先修課程

無，但修習過下列課程者佳。

數理類：統計學、計量經濟學、財務數學

財務類：財務管理、投資學、金融市場

課程與系所基本素養及核心能力之關連

- 具備職場專業財金技能
- 擁有探索與解決問題的能力
- 具有財金資訊蒐集與分析能力
- 具備責任感與倫理素養

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 】
--------	--------------	------------------	------	---------------	---------------------	---------------------------

具備職場專業財金技能	40%	商管基礎知識 財富規劃與投資 財金實務技能 國際視野	講述法 個案討論 實務操作(實驗、上機或實習等) 專題演講	期中考: 30% 作業: 20% 課堂討論: 20% 課程參與度: 30%	加總: 100	40
擁有探索與解決問題的能力	20%	團隊合作 創新思考 主動探索與解決問題 人際關係與溝通	講述法 個案討論 實務操作(實驗、上機或實習等) 專題演講	期中考: 30% 作業: 20% 課堂討論: 20% 課程參與度: 30%	加總: 100	20
具有財金資訊蒐集與分析能力	30%	邏輯推理能力 金融情勢分析 資料收集與整合應用	講述法 個案討論 實務操作(實驗、上機或實習等) 專題演講	期中考: 30% 作業: 20% 課堂討論: 20% 課程參與度: 30%	加總: 100	30
具備責任感與倫理素養	10%	責任感 財金倫理 社會關懷	講述法 實務操作(實驗、上機或實習等) 專題演講	期中考: 30% 作業: 20% 課堂討論: 20% 課程參與度: 30%	加總: 100	10

成績稽核

期中考: 30%
課程參與度: 30%
作業: 20%
課堂討論: 20%

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
現代投資學:分析與管理	謝劍平		智勝文化出版社	0

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
無參考教材及專業期刊導讀				

上課進度		分配時數(%)				
週次	教學內容	講授	示範	習作	實驗	其他
1	投資導論					
2	金融市場與有價證券					
3	證券市場					
4	共同基金					
5	利率與利率期間結構					
6	債券的特性與評價					
7	利率風險與債券的投資管理					
8	股票評價模型介紹					
9	期中考					
10	股票基本分析					
11	技術分析、市場效率性與股價行為					
12	業師課程					
13	業師課程					
14	業師課程					
15	業師課程					
16	業師課程					
17	業師課程					
18	期末考					