

開南大學 95 年度第 2 學期 財務金融 學系科目教學計劃表

課程編號	1	0	5	0	3	2	7	0	0	<input checked="" type="checkbox"/> 必修 <input type="checkbox"/> 選修	授課教師：陳泰源 開課系所：財務金融 年級班別：3 年 A 班	老師 學系
班次	01											
課程名稱(中文)										學分數	課程名稱(英文)	
投資組合與證券分析										3	Portfolio Management and Security Analysis	
教學目標與內容	以敘述說明方式解釋相關理論，並說明現有投資工具，除國內市場外，並涉獵國外主要市場操作模式。理論部分包括如何為投資進行評價以及如何建立一個滿足個人風險需求的投資組合。											
實施方法	<input checked="" type="checkbox"/> 講解法 <input checked="" type="checkbox"/> 實作法 <input type="checkbox"/> 討論法 <input type="checkbox"/> 演習法 <input checked="" type="checkbox"/> 問答法 <input type="checkbox"/> 其他_____											
評量方式	期中測驗 35% 期末測驗 35% 平時成績 10% 報告成績 20%											
授課使用及參考書籍	(請按作者、書名、版別、出版商、發行地、出版年份、起訖頁數順序填寫)。 李永全 『投資組合管理與分析』初版，高立圖書有限公司，台灣，2005 年 9 月。											
科目簡介(可含大綱及教學進度)：												
第一章 投資組合管理的系統方法 第二章 投資組合規劃 第三章 投資風險與報酬 第四章 效率市場理論 第五章 投資組合建構 第六章 資本市場理論與投資組合應用 第七章 套利定價理論與多因子模型 第十章 股票評價模型與應用 第十一章 股票投資風格 第十二章 股票投資組合策略 第八章 債券評價與風險分析 第九章 債券投資組合策略 第十三章 金融期貨：評價與投資組合策略 第十四章 選擇權：評價與投資組合策略												
說明：												
7. 授課教師於學期前填寫本表，經課程委員會審核後，影印分送給教師所屬課程委員會召集人，授課班級所屬系、所及教務處課務組；並於開始上課時，將本內容向學生說明。												
8. 本表於 91.4.23 第四次校課程委員會討論通過。												

課程委員會召集人：

授課教師：陳泰源

財金系
主任 何文榮