



課 綱 Course Outline

財務金融學系學士班

中文課程名稱 Course Name in Chinese	投資組合理論				
英文課程名稱 Course Name in English	Portfolio Theory				
科目代碼 Course Code	FIN_40300	班 別 Degree	學士班 Bachelor' s		
修別 Type	學程 Program	學分數 Credit(s)	3.0	時 數 Hour(s)	3.0
先修課程 Prerequisite	投資學				
課程目標 Course Objectives					
本課程介紹建構投資組合之理論基礎及證券分析，並藉著不同證券的相互搭配，來了解投資組合的管理方式及評價。期使同學能了解投資組合的理論並具備實務分析的能力。					
系教育目標 Dept.' s Education Objectives					
1	培育財務金融業之管理人 Cultivate talents with a skill of financial management.				
2	培育具備投資理財能力之人才 Cultivate talents with a skill of investment and manage finances.				
3	培育政府及企業所需之財務人才 Trains the talents needed for our nation's economic and business environment				
系專業能力 Basic Learning Outcomes				課程目標與系專業能力相關性 Correlation between Course Objectives and Dept.' s Education Objectives	
A	具備經濟學、會計學、統計學及數學的基礎能力 Basic knowledge of the financial theory Economics, accounting, statistical and mathematica			●	
B	具備財務金融基本學理 Understanding of the development of the financial disciplin			●	
C	具備運用財務金融學理進行分析能力 Basic knowledge of financial theory analysi			●	
D	具備資料整理、書面呈現或口頭報告之能力 Basic knowledge of documentation and presentation skill			●	
E	具備財經時事基本分析能力 Capabilities for financial analysis of current affairs			●	

F	具備電腦程式運算及應用基本能力 Ability of computer programs, algorithms and applications	○
G	具備英語閱讀溝通協調等基本能力 English reading ability of communication and coordination	
圖示說明Illustration：● 高度相關 Highly correlated ○ 中度相關 Moderately correlated		
課程大綱 Course Outline		
本課程可概分為三部分： 一、投資組合建構之理論基礎 二、資本市場定價模型 三、投資組合之績效及管理		
資源需求評估（師資專長之聘任、儀器設備的配合．．．等） Resources Required (e.g. qualifications and expertise, instrument and equipment, etc.)		
企管、經濟、財金教授 IBM PC &軟體 證券市場資料庫		
課程要求和教學方式之建議 Course Requirements and Suggested Teaching Methods		
課堂講授、作業及報告		
其他 Miscellaneous		
定期考試、作業及報告、課堂參與		