

開課學期 99-2

一、目的：本課程之目的在使學生

- 1.瞭解證券市場之性質組織及實務問題。
- 2.研習投資學之理論。
- 3.建立未來研究財務理論之基礎。

二、課本：Z. Bodie, A. Kane, and A.J. Marcus, Essentials of Investments, McGraw-Hill, 8th Edition, 2010.

(新月書局及東華書局 Tel : 02-2331-1578,02-2331-7856)

三、補充教材

本課程涵蓋範圍較廣，故下列教材均可能用到，部份補充教材會透過網路印發。

- 1.W.F. Sharpe, G.J. Alexander and J.V. Bailey, Investments, 7th Edition,2003, Prentice Hall.
- 2.E.J. Elton & M.J. Gruber, S. Brown and W.Goetzmann, Modern Portfolio theory & Investment Analysis, John Wiley & Sons , 7th Edition,2007(華泰書局)。
- 3.林煜宗，現代投資學，制度理論與實務，任何一版。
- 4.張齡松，羅俊，股票操作學，證券出版社，任何一版。
- 5.張齡松，羅俊，短線法寶，證券出版社，任何一版。
- 6.陳明智，智慧型股票操作法3版，邯鄲出版社。
- 7.證期局，台灣證券交易所，復華證券金融公司出版之各種刊物。
- 8.工商時報，經濟日報。
- 9.強力陰陽線，寰宇公司

四、作業

- 1.作業分兩種，一為學生個別作業，一為學生分組作業。
- 2.選課學生並須經常閱讀經濟日報或工商時報。
- 3.四、五月間選課學生需完成紙上模擬投資操作作業。

五、評分：上課表現、作業成績、考試成績

六、上課內容

- 1.證券市場、證券概論、證券市場組織、實務問題、上市與上櫃、融資融券制度。

- Ch. 1,2,3. (以台灣的情況為主要教材)
- 2.投資組合理論。Ch.5,6.
- 3.資本市場理論—CAPM 及 APT。Ch. 7.
- 4.效率市場假說。Ch. 8.
- 5.債券評價、分析與管理。Ch. 10, 11.
- 6.基本分析、討論普通股評價方法。Ch.12,13,14.
- 7.技術分析。Ch. 9.(但以補充教材為主)
- 8.衍生性商品市場。part V
- 9.投資組合評估及管理。Ch. 18.
- 10.投資公司—共同基金。Ch. 4.