

[回上一頁](#) [列印](#)

國立高雄科技大學
NATIONAL KAOHSIUNG
UNIVERSITY OF SCIENCE
AND TECHNOLOGY
授課大綱 Syllabus

部別：日間部碩士

112學年度第2學期

列印日期：2024/03/04

中文課程名稱：共同基金管理

英文課程名稱：Mutual Fund Management

授課教師：宋兆賢

開課班級：金融碩士班一甲

學分：3.0

授課時數：3.0

合班班級：

實習時數：0.0

1. 中文教學目標(Chinese Teaching objectives)

1. 了解不同類型的共同基金及其投資目標。 2. 分析各種資產類別及其在投資組合建構中的作用。 3. 使用風險調整報酬指標評估投資組合績效。 4. 辨識和評估基金經理人所採用的不同投資風格和策略。 5. 了解共同基金的監管環境和產業機構的角色。 6. 培養批判性思考技能，以選擇和監控投資組合的共同基金。

2. 英文教學目標(English Teaching objectives)

1. Understand the different types of mutual funds and their investment objectives. 2. Analyze the various asset classes and their role in portfolio construction. 3. Evaluate portfolio performance using risk-adjusted return metrics. 4. Identify and assess different investment styles and strategies employed by fund managers. 5. Comprehend the regulatory landscape governing mutual funds and the role of industry institutions. 6. Develop critical thinking skills for selecting and monitoring mutual funds for investment portfolios.

3. 中文教學綱要(Chinese CourseDescription)

本課程深入探討共同基金管理的實際世界，研究投資策略、投資組合建構、績效評估和監管方面。透過理論和現實例子的結合，學生將獲得對基金管理動態領域的寶貴見解，並培養出於投資目的分析和評估各種共同基金所需的技能。

4. 英文教學綱要(English CourseDescription)

This course delves into the practical world of mutual fund management, examining investment strategies, portfolio construction, performance evaluation, and regulatory aspects. Through a blend of theory and real-world examples, students will gain valuable insights into the dynamic realm of fund management and develop the skills needed to analyze and evaluate various mutual funds for investment purposes.

5. 中文核心能力

核心能力名稱(中)	核心能力名稱(英)	核心能力百分比	備註
使用資訊科技解決新問題的能力。			
分析與預測國內與國際經濟環境的能力。			
以國際觀點分析各種金融管理議題的能力。			
運用統計分析和科學管理從事決策制定的能力。			
熟悉各項金融法規以及研判未來修法方向的能力。			
應用與發展財務理論、財務分析與財務報告的能力。			

熟悉各項銀行業務內容與運作原理、金融商品及其定價原理、領導與管理銀行的能力。

無英文核心能力資料。

無教科書資料。

8. 參考書

中文書名： 英文書名：Investments

中文作者： 英文作者：Zvi Bodie, Alex Kane, and Alan Marcus

1 中文出版社： 英文出版社：McGraw Hill

出版日期：2021年01月 備註：

9. 教學進度表

週次或項目 Week or Items	中文授課內容 Chinese Course Content	英文授課內容 English Course Content	分配節次 Assigned Classes	備註 Note
共同基金簡介 Introduction to Mutual Funds	了解投資人可用的共同基金的結構、運作和類型。	Understanding the structure, operation, and types of mutual funds available to investors.	3	
資產類別與投資策略 Asset Classes and Investment Strategies	深入研究主要資產類別（股票、固定收益、另類投資）以及不同基金類別所採用的投資策略。	Deep dive into major asset classes (equities, fixed income, alternatives) and the investment strategies employed by different fund categories.	3	
投資組合建構與多元化 (1) Portfolio Construction and Diversification(1)	投資組合建構與多元化：探索投資組合建構原則、多元化技術和資產配置模型(1)	Portfolio Construction and Diversification: Exploring the principles of portfolio construction, diversification techniques, and asset allocation models.(1)	3	
投資組合建構與多元化 (2) Portfolio Construction and Diversification(2)	投資組合建構與多元化：探索投資組合建構原則、多元化技術和資產配置模型(2)	Portfolio Construction and Diversification: Exploring the principles of portfolio construction, diversification techniques, and asset allocation models.(2)	3	
績效衡量和評估(1) Performance Measurement and Evaluation(1)	績效衡量和評估：使用風險調整回報（夏普比率、索蒂諾比率、特雷諾比率）、風險分析和阿爾法生成來評估共同基金的績效。(1)	Performance Measurement and Evaluation: Evaluating mutual fund performance using risk-adjusted returns (Sharpe Ratio, Sortino Ratio, Treynor Ratio),	3	

		risk analysis, and alpha generation.(1)	
績效衡量和評估(2) Performance Measurement and Evaluation(2)	績效衡量和評估：使用風險調整回報（夏普比率、索蒂諾比率、特雷諾比率）、風險分析和阿爾法生成來評估共同基金的績效。(2)	Performance Measurement and Evaluation: Evaluating mutual fund performance using risk-adjusted returns (Sharpe Ratio, Sortino Ratio, Treynor Ratio), risk analysis, and alpha generation.(2)	3
投資風格與主動式管理(1) Investment Styles and Active Management(1)	投資風格與主動式管理：研究不同的投資風格（成長型、價值型、逆勢型、動量型）以及主動管理者如何實施這些投資風格以跑贏市場。(1)	Investment Styles and Active Management: Examining different investment styles (growth, value, contrarian, momentum) and how active managers implement them to outperform the market.(1)	3
投資風格與主動式管理(2) Investment Styles and Active Management(2)	投資風格與主動式管理：研究不同的投資風格（成長型、價值型、逆勢型、動量型）以及主動管理者如何實施這些投資風格以跑贏市場。(2)	Investment Styles and Active Management: Examining different investment styles (growth, value, contrarian, momentum) and how active managers implement them to outperform the market.(2)	3
期中考 midterm exam	期中簡報	Team-based research topics presentation	3
被動管理與指數基金 Passive Management and Index Funds	被動管理與指數基金：了解被動管理、指數基金的角色及其對共同基金產業的影響。	Passive Management and Index Funds: Understanding the role of passive management, index funds, and their impact on the mutual fund industry.	3
主動型基金管理策略(1) Active Fund Management Strategies(1)	主動型基金管理策略：深入分析具體的主動型基金管理策略（產業輪動、選股、量化分析）及其成效。(1)	Active Fund Management Strategies: In-depth analysis of specific active fund management strategies (sector rotation, stock picking, quantitative analysis) and their effectiveness.(1)	3
主動型基金管理策略(2) Active Fund Management Strategies(2)	主動型基金管理策略：深入分析具體的主動型基金管理策略（產業輪動、選股、量化分析）及其成效。(2)	Active Fund Management Strategies: In-depth analysis of specific active fund management strategies (sector rotation, stock picking, quantitative analysis) and their effectiveness.(2)	3

共同基金與個人財務規劃 Mutual funds and individual financial planning	共同基金與個人財務規劃：共同基金的選擇、資產配置以及不同類型共同基金的多元化	Mutual funds and individual financial planning: mutual funds selection, asset allocations and diversification across different types of mutual funds	3
科技進步 Technological Advancements	科技進步的影響：共同基金中的金融科技、自動化、大數據、網路安全與風險管理	The impacts of Technological Advancements: Fintech, automation, big data and cybersecurity and risk management in Mutual Funds	3
共同基金業的欺詐及案例分析 Frauds with mutual fund industry and case studies	共同基金業的欺詐及案例分析	Frauds with mutual fund industry and case studies	3
共同基金的監管環境 The Regulatory Environment of Mutual Funds	共同基金的監管環境：了解證券交易委員會和其他監管機構在管理共同基金和解決道德問題方面的作用。	The Regulatory Environment of Mutual Funds: Understanding the role of the Securities and Exchange Commission (SEC) and other regulatory bodies in governing mutual funds, and addressing ethical considerations.	3
共同基金產業的專題、新興趨勢與挑戰 Special topics, trends and challenges	共同基金產業的專題、新興趨勢與挑戰	Special Topics, emerging Trends and challenges within mutual fund industry	3
期末簡報	期末簡報：學生對共同基金產業內的投資組合建構模擬專案進行詳細分析	Final Presentation: Students present a detailed analysis on the portfolio construction simulation project within the mutual fund industry	3

10. 中文成績評定(Chinese Evaluation method)

1. 課堂參與 (20%) 2. 作業和測驗 (30%) 3. 期中簡報 (20%) 4. 最終簡報 (30%)

11. 英文成績評定(English Evaluation method)

1. Class participation (20%) 2. Assignments and quizzes (30%) 3. Midterm presentation (20%) 4. Final presentation (30%)

12. 中文課堂要求(Chinese Classroom requirements)

1. 積極參與課堂討論和個案分析。 2. 關於共同基金管理選定主題的團隊研究項目和簡報。 3. 基於團隊的作品集建構模擬專案簡報。

13. 英文課堂要求(English Classroom requirements)

1.Active participation in class discussions and case study analyses. 2.Team-based research project and presentation on a chosen topic in mutual fund management. 3.Team-based portfolio construction simulation project presentation.

14. 本課程與SDGs相關項目(This course is relevant to these of SDGs as following_)

4. 優質教育(Quality Education);

「遵守智慧財產權」；「不得非法影印」！