

國立高雄大學金融管理學系

一百學零一年度第一學期第二次系課程委員會議紀錄

會議日期：民國 102 年 01 月 16 日(星期三)中午 12 時整

會議地點：管院306會議室

出席人員：高蘭芬老師、黃旭輝老師、陳怡凱老師、張志向老師、蔡怡純老師、楊琬如老師、

余歆儀老師、蔡明憲老師、王文楷老師、王功亮老師、李佳樺同學、劉芸君同學

請假人員：黃一祥老師、余文彬會計師

主 席：高蘭芬老師

記錄：吳玉婷

壹、主席報告：無

貳、確認 101 學年度第一學期第一次系課程委員會會議紀錄。(附件一， p.3)

參、會議議程：

提案一：有關「101 學年度第二學期新開選修課程」乙案(附件二 p.4~11)，提請 討論。

說 明：

學制	課程名稱	學分數	授課教師	上課人數	備註
大學部-3、4 年級	投資策略理論與實務	3	余歆儀老師	30	p. 4~ p. 6
碩士班-1、2 年級	資產評價	3	余歆儀老師	6	p. 7~ p. 11

決議：照案通過。

提案二：有關「A1001230 謝京陸同學申請雙主修免修課程」乙案(附件三 p.12~p.13)，提請 討論。

說 明：申請免修課程如附件三 p.12~p.13，共計申請免修 15 學分。

決議：除本系專任教師開設之專業必選修課程外，授權該科授課教師決定。

a. 同意：會計學一、二；管理學；行銷管理，小計十二學分；

b. 不同意：經濟學原理一；

提案三：有關「A1003324 許鈺佩同學申請雙主修免修課程」乙案(附件四 p.14~p.15)，提請 討論。

說 明：申請免修課程如附件四 p.14~p.15，共計申請免修 21 學分。

決議：除本系專任教師開設之專業必選修課程外，授權該科授課教師決定。

同意：經濟學原理一、二；會計學一、二；統計學一；管理學；計算機概論，共計21學分

提案四：檢視「國立高雄大學金融管理學系核心能力」乙案（附件五 p.16～p.19），提請 討論。

說明一：依據 101 年 11 月 21 日本系自我評鑑時委員建議：

1. 針對碩士班與大學部的基本核心能力增列細部說明(p.16)。
2. 檢視校、院級與本系的核心能力關聯度(p.17)。

說明二：檢視本系核心能力與課程的關聯度(p.18～p.19)。

說明三：依據余文彬委員建議：課程可增加（一）信託介紹之相關課程；（二）財富管理等相關稅務的課程，如遺產、贈與稅等。

決議一：關於自我評鑑委員的建議增列細部說明與核心能力關聯度照案通過；

決議二：針對余文彬委員建議，回應如下：

1. 信託介紹之相關課程，本系於a. 不動產投資管理 b. 證券投資投資分析等課程皆有安排相關介紹，未來會於課程中強化信託相關內容。
2. 財富管理等相關稅務課程，本系也於a. 個人理財 b. 投資學等相關課程中安排相關介紹，未來會於課程中強化財富管理等相關內容。
3. 為強化稅務相關法規等內容課程，將預計邀請相關專業專家、學者蒞臨系上做演講；抑或於本系必修課程「民法概要」中做補強。

肆:臨時動議:無

伍:散會：13：00

國立高雄大學金融管理學系

一百學零一年度第一學期第一次系課程委員會會議紀錄

會議日期：民國 101 年 11 月 14 日(星期三)下午 3 時整

會議地點：管院306會議室

出席人員：高蘭芬老師、黃旭輝老師、陳怡凱老師、張志向老師、蔡怡純老師、楊琬如老師、余欽儀老師、蔡明憲老師、王文楷老師、王功亮老師、李佳樺同學、劉芸君同學

請假人員：黃一祥老師

主席：高蘭芬老師

記錄：吳玉婷

壹、主席報告：無

貳、確認 100 學年度第二學期第二次系課程委員會會議紀錄。(附件一，p. 2~p. 3)

參、會議議程：

提案一：有關「更新金融管理學系大學部修業規定之專業選修科目表」乙案(附件二 p. 4)，提請 討論。

說明：增列近年開設之選修課程與刪除近五年未開設之選修課程。

決議：照案通過。

提案二：有關「修正國立高雄大學金融管理學系(所)碩士班專業必修科目表」乙案(附件三 p. 7)，提請 討論。

說明：因應「國立高雄大學金融管理學系碩士班修業規則」修正之法規-

1. 刪除論文六學分
2. 「財金專題研討」一~四課程各為 2 學分，故修正專業必修科目表。

決議：照案通過。

提案二：有關「修正國立高雄大學金融管理學系(所)碩士班專業選修科目表」乙案(附件四 p. 8~p. 9)，提請 討論。

說明：增列近年開設之選修課程與刪除近五年未開設之選修課程。

決議：照案通過。

肆：臨時動議：無

伍：散會：15：40

Lecturer: Hsin-Yi Yu (余歆儀)

壹、 Aims

Since the course is an optional course for the postgraduates, it is not only lecture-intensive but also research-intensive for training critical thinking about academic and real-world issues. The core of this course is to teach students how to construct portfolios by using various investment strategies.

After taking this course, students should be able:

- (1) To understand the background and basic points of investment strategies, the structure of portfolios, and the importance and application of various investment strategies.
- (2) To conduct basic programming, including ACCESS and VBA and to do empirical projects on constructing portfolios by using various investment strategies.

B. Outline

The course can be grouped into three parts. The first part is the introduction of the academic thinking regarding the relationship between investment strategies and portfolios. The second part is to teach students how to program by using ACCESS and EXCEL. The third part is to combine the strategies learned in the first part and the skills learned in the second part to form various portfolios by using real data.

C. Teaching Method

Classes will be comprised of a combination of mini-lectures, discussions, and programming implementation. Students will be expected to participate fully in class discussions and to present materials. Effective participation will require preparation of cases and assigned readings in advance of each class. Because much of the course is discussion-oriented, it is critical for students to keep up with the readings and come prepared to each class. It is important to have an effective learning environment where everyone is free to discuss energetically all relevant ideas, issues and concepts raised by within the course.

D. Grading

Students are required to be divided into groups.

Presentation

1. Each person is required to give ONE book presentation and ONE final essay about 7-10 specific investment strategies.
2. After each presentation, another person is required to act as a discussant (i.e. raising questions and giving comments).

3. In addition to oral presentations, each person is also required to submit a report (5-10 pages) which demonstrates a comprehensive, thorough, and in-depth understanding of the paper or the case reported by him/her. The report must contain comments.

Assessment Criteria:

Form of assessment	Percentage	Explanation
⊙ Financial news oral presentation	15%	
⊙ Participation during lectures	15%	Encourage students to raise questions during lectures.
⊙ Oral presentations of paper		
(1) Paper oral presentation	20%	The report MUST contain <u>comments</u> .
(2) Paper Report (5-10 pages)	15%	
⊙ Oral presentations of project		
(1) Essay Oral Report	20%	
(2) Essay paper (3-5 pages)	15%	

E. Textbook

1. The Handbook of Equity market Anomalies
 Author: Zacks, Leonard
 Publisher: Wiley; 1 edition (October 4, 2011)
 Language: English
 ISBN-10: 0470905905
 ISBN-13: 978-0470905906
2. My Life as a Quant: Reflections on Physics and Finance (有中文版)
 Author: Derman, Emanuel
 Publisher: Wiley; 1 edition (December 21, 2007)
 Language: English
 ISBN-10: 0470192739
 ISBN-13: 978-0470192733

F. Teaching Schedule

Part 1 How to deal with data and program?

Topic 1 ACCESS

1. Head First SQL

作者：Beighley, Lynn

出版社：Oreilly & Associates Inc

ISBN：0596526849

Topic 2 Combine ACCESS and EXCEL

1. 財務軟體應用:Excel VBA 入門與在財務工程的應用 第一版 (附學生學習光碟)

作者：張大成

出版社：雙葉書廊

ISBN：9789866672460

Part 2 The introduction of investment strategy and portfolio

Topic 1: Introduction

Topic 2: Portfolio and anomalies

- A. Factor Models
- B. Size and Value Strategy
- C. Fundamental Anomalies
- D. Momentum and Reversal
- E. Asset Growth Effect
- F. Accruals

Topic 3: Fund Performance

Topic 4: Fund Timing Ability

Topic 5: Fund Flow and Smart Money Effect

G. Important Dates

1. Break time: 4/4, 4/11 (in Florida), 6/20
2. Book report: 3/21, 4/25
3. Final Essay report: 6/13

資產評價

Asset Pricing

Lecturer: Hsin-Yi Yu (余歆儀)

貳、 Aims

Since the course is an optional course for the postgraduates, it is not only lecture-intensive but also research-intensive for training critical thinking about academic and real-world issues. The core of this course is to teach students how to construct portfolios by using various investment strategies.

After taking this course, students should be able:

- (3) To understand the background and basic points of investment strategies, the structure of portfolios, and the importance and application of various investment strategies.
- (4) To conduct basic programming, including C#, ACCESS, and VBA and to do empirical projects on constructing portfolios by using various investment strategies.

B. Outline

(1) The course can be grouped into three parts. The first part is the introduction of the academic thinking regarding the relationship between investment strategies and portfolios. The second part is to teach students how to program by using ACCESS, EXCEL and C#. The third part is to combine the strategies learned in the first part and the skills learned in the second part to form various portfolios by using real data.

(2) Please see READING LIST below for more information.

E. Teaching Method

Classes will be comprised of a combination of mini-lectures, paper discussions, and programming implementation. Students will be expected to participate fully in class discussions and to present materials. Effective participation will require preparation of cases and assigned readings in advance of each class. Because much of the course is discussion-oriented, it is critical for students to keep up with the readings and come prepared to each class. It is important to have an effective learning environment where everyone is free to discuss energetically all relevant ideas, issues and concepts raised by within the course.

F. Grading

Students are required to be divided into groups.

Weekly Assignment

Students are expected to read Financial Times, WSJ, Asia WSJ, or other business-related articles. Each person is required to give an oral presentation for the latest financial news for at most 10 minutes and share what issues they have learned from the news with other students.

Presentation

4. Each person is required to give **ONE** news presentation, **ONE** presentation concerning relevant paper, and **ONE** final essay about **7-10** specific investment strategies.
5. After each presentation, another person is required to act as a discussant (i.e. raising questions and giving comments).
6. In addition to oral presentations, each person is also required to submit a report (5-10 pages) which demonstrates a comprehensive, thorough, and in-depth understanding of the paper or the case reported by him/her. The report must contain comments.

Assessment Criteria:

Form of assessment	Percentage	Explanation
⊙ Financial news oral presentation	15%	
⊙ Participation during lectures	15%	Encourage students to raise questions during lectures.
⊙ Oral presentations of paper		
(1) Paper oral presentation	20%	The report MUST contain <u>comments</u> .
(2) Paper Report (5-10 pages)	15%	
⊙ Oral presentations of project		
(1) Essay Oral Report	20%	
(2) Essay paper (3-5 pages)	15%	

E. Textbook

There is no single book that covers the material in this course. Instead there is a set of required cases and readings from journals, book chapters etc.

READING LIST

Part 1 The introduction of investment strategy and portfolio

Topic 1: Introduction

1. Cochrane, John H. Asset Pricing. Preface (Book)

Topic 2: Portfolio and anomalies

G. Factor Models

17. Fama, Eugene F., and Kenneth R. French, 1992, The cross-section of expected stock returns, *Journal of Finance* 47, 427–465.
18. Fama, Eugene F., and Kenneth R. French, 1993, Common risk factors in the returns on stocks and bonds, *Journal of Financial Economics* 33, 3–56.
19. Carhart, Mark M., 1997, On persistence in mutual fund performance, *Journal of Finance* 52, 57-82.
20. Daniel, K., and S. Titman, 1996, Evidence on the characteristics of cross sectional variation in stock returns, *Journal of Finance* 52, 1-33.

H. Momentum and Reversal

21. Jegadeesh, Narasimhan, and Sheridan Titman, 1993, Returns to buying winners and selling losers: Implications for stock market efficiency, *Journal of Finance* 48, 65–91.
 22. Daniel, Kent, David Hirshleifer, and Avanidhar Subrahmanyam. 1998. “Investor Psychology and Security Market Under- and Overreactions.” *Journal of Finance* 53 (6) (December): 1839-1885.
 23. Hong, Harrison, and Jeremy C. Stein. 1999. “A Unified Theory of Underreaction, Momentum Trading, and Overreaction in Asset Markets.” *Journal of Finance* 54 (6) (December): 2143-2184.
 24. Hong, Harrison, Terence Lim, and Jeremy C. Stein. 2000. “Bad News Travels Slowly: Size, Analyst Coverage, and the Profitability of Momentum Strategies.” *Journal of Finance* 55 (1) (February): 265-295.
 25. George, Thomas J., and Chuan-Yang Hwang. 2004. “The 52-week High and Momentum Investing.” *Journal of Finance* 59 (5) (October): 2145-2176.
 26. Chordia, Tarun, and Lakshmanan Shivakumar. 2002. “Momentum, Business Cycle, and Time-varying Expected Returns.” *Journal of Finance* 57 (2) (April): 985-1019.
 27. Chen and Yu, 2011, Momentum-Reversal Strategy, Working paper
 28. Subramanhyam, Wei, and Yu, 2012, Limited Attention, Salience, and Stock Returns, Working paper.

I. Asset Growth Effect

29. Titman, Sheridan, K. C. John Wei, and Feixue Xie. 2004. “Capital Investments and Stock Returns.” *Journal of Financial and Quantitative Analysis* 39 (04) (April 6): 677-700..
30. Lam, F.Y. Eric C., and K.C. John Wei. 2011. “Limits-to-arbitrage, Investment Frictions, and the Asset Growth Anomaly.” *Journal of Financial Economics* 102 (1) (October): 127-149.
31. Cooper, Michael J., Huseyin Gulen, and Michael J. Schill. 2008. “Asset Growth and the Cross-section of Stock Returns.” *Journal of Finance* 63 (4) (August): 1609-1651.
32. Cooper, Ilan, and Richard Priestley. 2011. “Real Investment and Risk Dynamics.” *Journal of Financial Economics* 101 (1) (July): 182-205.

J. Industry

33. Cohen, Lauren, and Andrea Frazzini, 2008, Economic links and predictable returns, *Journal of Finance* 63, 1977–2011.
34. Menzly, Lior, and Oguzhan Ozbas, 2010, Market segmentation and cross-predictability of returns, *Journal of Finance* 65, 1555-1580
35. Hou, Kewei, and David T. Robinson, 2006, Industry concentration and average stock returns. *Journal of Finance* 61, 1927 – 1956.
36. Goetzmann, William N., Akiko Watanabe, and Masahiro Watanabe. 2010. “Procyclical Stocks Earn Higher Returns.” Working paper.

E. Accruals

F. Fundamentals

Topic 3: Fund Performance

A. Performance evaluation and persistence

25. Daniel, Kent, Mark Grinblatt, Sheridan Titman, and Russ Wermers, 1997, Measuring mutual fund performance with characteristic-based benchmarks, *Journal of Finance* 52, 1035-1058.

B. Fund timing ability

23. Bollen, Nicolas P. B. and Jeffrey A. Busse, 2004, Short-term persistence in mutual fund performance, *Review of Financial Studies* 18, 569-597.

C. Fund flow and smart money effect

24. Sapp, Travis, and Ashish Tiwari, 2004, Does stock return momentum explain the “smart money” effect? *Journal of Finance* 59, 2605–2622.
25. Keswani, Aneel, and David Stolin, 2008, Which Money Is Smart? Mutual Fund Buys and Sells of Individual and Institutional Investors, *Journal of Finance* 63, 85–118.
26. Gruber, Martin J., 1996, Another puzzle: The growth in actively managed mutual funds, *Journal of Finance* 51, 783–810.
27. Zheng, Lu, 1999, Is money smart? A study of mutual fund investors’ fund selection ability, *Journal of Finance* 54, 901–933.
28. Yu, H.- Y, Where Are the Smart Investors? New Evidence of the Smart Money Effect, *Journal of Empirical Finance*, 19, 51-64.

Topic 4: Other interesting topics

29. Barberis, Nicholas, Andrei Shleifer, and Jeffrey Wurgler. 2005. “Comovement.” *Journal of Financial Economics* 75 (2) (February): 283-317.
30. Barber, B. M., and T. Odean, 2008, All That Glitters: The Effect of Attention and News on the Buying Behavior of Individual and Institutional Investors, *Review of Financial Studies* 21, 785–818.

Part 2 How to deal with data and program?

Topic 1 ACCESS

1. Head First SQL

作者：Beighley, Lynn

出版社：Oreilly & Associates Inc

ISBN：0596526849

Topic 2 Combine ACCESS and EXCEL

1. 財務軟體應用:Excel VBA 入門與在財務工程的應用 第一版 (附學生學習光碟)

作者：張大成

出版社：雙葉書廊

ISBN：9789866672460

F. Important Dates

4. Break time: 4/4, 4/11 (in New York), 6/20

5. News report: 3/21, 4/25, 5/23

6. Final paper report: 6/8

7. Final Essay report: 6/13

國立高雄大學金融管理學系雙主修免修課程申請表

101 年 09 月 19 日系務會議通過

申請日期: 2012.11.29

姓名: 謝京陸 學號 A1001270

主系(所): 運動健康與休閒學系						本系科目學分				審核意見	
編號	科目(原系所)	開課學期	學分	成績	選/必修	申請免修科目	開課學期	學分	選/必修	意見	簽核
1 ABADA	會計學(-)	上	3	63	必	會計學原理(-)	上	3	必	☐ 同意 ☐ 不同意	
2 KHAH	經濟學	上	3	77	選	經濟學原理(-)	上	3	必	☐ 同意 ☐ 不同意	
3 ABADA	會計學(二)	下	3	66	必	會計學原理(二)	下	3	必	☐ 同意 ☐ 不同意	
4 KHAH	管理學	下	3	82	必選	管理學	下	3	必	☐ 同意 ☐ 不同意	
5 KHAH	行銷學	下	3	76	選	行銷管理	下	3	選	☐ 同意 ☐ 不同意	
6										☐ 同意 ☐ 不同意	
7										☐ 同意 ☐ 不同意	
本系准予免修小計 _____ 科, _____ 學分											
申請人簽章及聯絡電話						系主任簽核				備註	
謝京陸 0986393747											

備註: 1. 請提供原系所成績單或學分證明正本核驗。

2. 申請必修免修課程不得多於 22 學分。

3. 核准後請保留此單到畢業, 若學分歸類核准有問題, 請自行提出。

國立高雄大學學生歷年成績表

姓名：謝京陸

學號：A1001230

學制：大學部

學院：人文社會科學院

系所：運動健康與休閒學系

輔系：

雙主修：

100學年度第1學期(100年9月-101年1月)

課程編號	課程名稱	學分	成績
ABA03A	(必)會計學(一)	3	63.00
CCI123	(選)哲學基本問題	2	87.00
GR1103	(必)中文(上)	2	92.00
GRA0B3	(必)英語會話與閱讀(上)：中階班	2	89.00
GRF123	(必)服務(學務處課輔組 A)	0	97.00
GRS12A	(必)體育(一)-運健體系	0	81.00
KHA082	(必)運動健康與休閒學導論	3	71.00
KHA19A	(必)人體解剖生理學(1)	2	86.00
KHA513	(選)運動技能學習	2	82.00
KHA522	(選)生命科學導論	3	88.00
KHA531	(選)經濟學	3	77.00
KHA532	(選)社會學	2	79.00

學業平均成績：80.29

操行成績：85.00

修習學分數：24

實得學分數：24

實得學分數累計：24

100學年度第2學期(101年2月-101年6月)

課程編號	課程名稱	學分	成績
ABA03B	(必)會計學(二)	3	66.00
GR4202	(必)中文(下)	2	91.00
GRA0BC	(必)英語會話與閱讀(下)：中階班	2	80.00
GRA122	(必)服務(運動健康與休閒學系)	0	90.00
KHA114	(必)環境健康學	2	76.00
KHA19B	(必)人體解剖生理學(2)	2	88.00
KHA533	(選)管理學	3	82.00
KHA534	(選)行銷學	3	76.00
KHB181	(必)普通心理學	2	93.00
SOA502	(選)不動產投資理財與簡易估價	2	88.00

學業平均成績：81.14

操行成績：82.00

修習學分數：21

實得學分數：21

實得學分數累計：45

修業起迄(100年9月-101年6月)

總實得學分數：45

總學業平均成績：80.69

教務處註冊組組長：

陳忠正

承辦人員：

李學佳

製表日期：

2012/11/16

國立高雄大學金融管理學系雙主修免修課程申請表

101年09月19日系務會議通過

申請日期: 2013.1.4

姓名: 許鈺佩

學號: A1003324

主系(所): 金融管理學系						本系科目學分				審核意見	
編號	科目(原系所)	開課學期	學分	成績	選/必修	申請免修科目	開課學期	學分	選/必修	意見	簽核
1	經濟學原理(一)	上	3	75	必	經濟學原理 I	上	3	必	☐ 同意 ☐ 不同意	
2	經濟學原理(二)	下	3	85	必	經濟學原理 II	下	3	必	☐ 同意 ☐ 不同意	
3	會計學 I	上	3	81	必	會計學原理 I	上	3	必	☐ 同意 ☐ 不同意	
4	會計學 II	下	3	85	必	會計學原理 II	下	3	必	☐ 同意 ☐ 不同意	
5	企業管理	上	3	77	必	管理學	下	3	必	☐ 同意 ☐ 不同意	
6	統計學 I	下	3	78	必	統計學 I	上	3	必	☐ 同意 ☐ 不同意	
7	計算機概論	上	3	79	必	計算機概論 I	上	3	必	☐ 同意 ☐ 不同意	
本系准予免修小計 7 科, 21 學分											
申請人簽章及聯絡電話						系主任簽核				備註	
許鈺佩 09-25306613											

備註: 1. 請提供原系所成績單或學分證明正本核驗。

2. 申請必修免修課程不得多於 22 學分。

3. 核准後請保留此單到畢業, 若學分歸類核准有問題, 請自行提出。

國立高雄大學一百學年度學生成績單

姓名：許鈺佩
學院：管理學院

學號：A1003324
系所：資訊管理學系

學制：大學部

100學年度第1學期(100年9月—101年1月)

課程編號	課程名稱	學分	成績
GR5503	(必)中文(上)	2	92.00
GRA0B2	(必)英語會話與閱讀(上)：中階班	2	77.00
GRS33A	(必)體育(一)-資管系	0	93.00
IMA011	(必)計算機概論	3	79.00
IMA051	(必)微積分	3	71.00
IMA08A	(必)會計學(一)	3	81.00
IMA10A	(必)經濟學原理(一)	3	75.00
IMA121	(必)企業管理	3	77.00
SCA795	(選)數位典藏概論	2	87.00
SCA804	(選)數位典藏系統理論與實作(一)	2	85.00
SOA954	(選)國際政經情勢分析	2	79.00

學業平均成績：79.56

操行成績：82.00

修習學分數：25

實得學分數：25

100學年度第2學期(101年2月—101年6月)

課程編號	課程名稱	學分	成績
ELA014	(必)基礎日語II	2	97.00
GR4102	(必)中文(下)	2	93.00
GRA0BB	(必)英語會話與閱讀(下)：中階班	2	86.00
GRA332	(必)服務(資訊管理學系)	0	92.00
GRS33B	(必)體育(二)-資管系	0	79.00
IMA02B	(必)會計學(二)(含實習)	3	83.00
IMA04B	(必)經濟學原理(二)(含實習)	3	85.00
IMA131	(必)程式設計	3	81.00
IMB02A	(必)統計學(一)	3	78.00
IMB081	(必)資訊管理導論	3	94.00

學業平均成績：86.43

操行成績：84.00

修習學分數：21

實得學分數：21

100學年度總實得學分數：46

100學年度平均成績：82.7

教務處註冊組組長：陳忠正

承辦人員：許芳儀

製表日期：2013/1/4

國立高雄大學
教務處
National University of Kaohsiung
Division of Academic Affairs

基本核心能力說明：說明各個核心能力在大學部與研究所的重點

基本能力	說明
數理邏輯與經濟分析的能力	<u>大學部</u> 著重於財金資料的收集與基礎數據分析，學生可以針對某個議題進行簡單的自我驗證。 <u>研究所</u> 著重進階的研究方法，強調分析方法的多樣化與縝密度。
搜集及解讀會計資訊的能力	<u>大學部</u> 了解如何依循會計準則記錄企業活動，並具備分析財務報表資訊的能力。 <u>研究所</u> 剖析財務報告資訊以評估企業價值，並了解會計資訊與資本市場之相關性。
個人及企業理財的能力	<u>大學部</u> 瞭解公司及個人基礎財務運作的可能方式與決策。 <u>研究所</u> 針對公司及個人的財務決策進行優劣分析與實證研究。
投資直接及間接金融市場的能力	<u>大學部</u> 瞭解各種投資工具與衍生性金融商品，並根據自身情況做出理財規劃。 <u>研究所</u> 深入討論不同金融商品之間的關係與定價模式。
金融創新及風險控管的能力	<u>大學部</u> 瞭解風險的定義、測量、評估。 <u>研究所</u> 結合新金融商品，討論並發展因應風險的策略。
金融倫理及服務的能力	<u>大學部與研究所</u> 了解金融交易中應遵循的道德準則和行為規範，加強道德教育。
國際化資訊應用的能力	<u>大學部</u> 瞭解財金專業英語、介紹國際財金形勢與國際財務管理。 <u>研究所</u> 使用財金專業英語進行討論、分析、與研究。並深入瞭解跨國公司之財務管理。

各級基本素養、核心能力比較：

	校級	院級	系級
基本素養	人文素養、 公民素養、 倫理素養、 科學素養、 專業素養。	1. 社會關懷及世界公民責任。 2. 人文素養與專業學理。 3. 當代思維與國際視野。	(一) 廣博進取。 (二) 誠信正直。 (三) 仁愛良善。 (四) 多元思考，發展創意。
核心能力	知識力、 社會力、 品格力、 創造力。	1. 資訊運用的知識力與判斷力。 2. 職場需求為導向的專業能力。 3. 與國際接軌提昇語文的能力。 4. 創新思維與主動學習的能力。 5. 以科學方法解決問題的能力。	(一) 數理邏輯與經濟分析的能力。 (二) 搜集及解讀會計資訊的能力。 (三) 個人及企業理財的能力。 (四) 投資直接及間接金融市場的能力。 (五) 金融創新及風險控管的能力。 (六) 金融倫理及服務的能力。 (七) 國際化資訊應用的能力。

配合以上七項能力，大學部課程分為三大類：(1) 金融管理的基礎，(2) 金融管理的應用，(3) 金融管理的進階。在各大類之中，又針對課程內容分為數個細項。細分如下：

課程分類		金融管理學系課程名稱
A. 金融管理的基礎	A.1 數理邏輯與經濟分析	經濟學原理(一)、統計學(一)、個體經濟學(一)、經濟學原理(二)、微積分(一)、總體經濟學、微積分(二)、統計學(二)、個體經濟學(二)、貨幣銀行學
	A.2 會計資訊	會計學原理(一)、中級會計學(一)、會計學原理(二)、中級會計學(二)、財務報表分析
	A.3 基礎能力培養	計算機概論(一)、計算機概論(二)、管理學、管理數學、行銷管理
	A.4 法律與倫理	民法概要、金融倫理
B. 金融管理的應用	B.1 投資專業	企業評價、企業評價與分析、不動產投資管理、金融市場與機構、固定收益型證券、投資學、投資組合管理、基金投資與管理、證券投資分析、公司治理、行為財務
	B.2 理財能力	財務管理(一)、財務管理(二)、個人理財
	B.3 經濟分析應用	計量經濟學
	B.4 會計資訊應用	財報分析
C. 金融管理的進階	C.1 金融創新	期貨與選擇權、複利數學、金融商品定價與投資組合
	C.2 風險管理	金融風險管理
	C.3 個案與專題	財務管理個案研究、公司理財、金融機構專題
	C.4 國際資訊	投資與財務規劃、國際財務管理、英文財金書報選讀

研究所課程亦分為三大類：(1) 金融管理的基礎，(2) 金融管理的應用，(3) 金融管理的進階。在各大類之中，又針對課程內容分為數個細項。詳情如下：

課程分類		金融管理學系課程名稱
A. 金融 管理的基 礎	A.1 數理邏輯	計量經濟學
	A.2 會計資訊	財務報表分析
	A.3 基礎能力培養	期貨與選擇權、金融市場
	A.4 法律與倫理	金融倫理
B. 金融 管理的應 用	B.1 投資專業	行為財務、投資組合研究、投資學、資產評價
	B.2 理財能力	公司理財、財務實證研究
	B.3 經濟分析應用	財務研究方法
	B.4 會計資訊應用	會計實證研究
C. 金融 管理的進 階	C.1 金融創新	實質選擇權、複利數學、期貨與選擇權、財務工程
	C.2 風險管理	金融機構管理、金融風險管理
	C.3 個案與專題	不對稱訊息之金融市場、財務專題研討(一)、財務專題研討(二)、財務專題研討(三)、財務專題研討(四)
	C.4 國際資訊	國際財務管理