

管院碩士班(含碩專班)課程大綱 ~ MS/MA Program Syllabus

2023.09.26 修訂版本；2026 內容更新

| | | | |
|---|--|-------------------------------|---|
| 系所 Department | 財金所 Finance | 必選修 compulsory/elective | 選修 Elective |
| 課程名稱 Course title | 財務分析 (Financial Analytics) | 學分數 Credit(s) | 3 |
| 課號 Course Code | 5155174 01 | 全英文授課 English Taught (EMI) | 否(No) |
| 學年/學期 academic year/Semester | 114-2 學期 Spring Semester 2026 | 上課地點 Classroom | 管院 401-3 |
| 講授教師 Instructor | 雲慕書 | 上課時間 Time | Thu. 13:10~16:00 |
| 教師辦公室&諮詢時間 Instructor office & office hour | Thu:16:10~17:00 管院 364 | 教師聯絡資訊 Instructor Contact | Phone: 34216 Email: mushuyun@ccu.edu.tw |
| 助教 Teaching assistant | | 助教 聯絡資訊 TA contact | Email: |
| 先修課程 Pre-requisite courses | Econometrics I | | |
| 學習目標 Learning Objective | Integrate knowledge in corporate finance, investment, and data analytics to implement a formal analysis process. | | |
| 課程概述 Course Descriptions | 本門課主要目的為訓練學生在財務資料上的實證分析能力，透過課堂指導、討論、與分組報告來熟悉該如何將所學的財務理論實際上投入市場分析。課堂使用的程式為SAS統計軟體。SAS在大量資料的處理上具有高度效率，並且包含了各種常財務資料常用的統計分析模組。透過程式撰寫，學生可以對於加深對於財務資料結構的了解、並熟悉該如何以程式語言和電腦溝通。這不論是對於接下來的論文撰寫、乃至於畢業後從事分析相關的工作都為不可或缺的技能。 | | |
| 對應 AOL 職能素養(AOL Competency) | | | |
| 職能素養 1(Competency 1): 知識整合 Knowledge Integration | | 選擇一個項目。 | |
| 課程類別 Course Attributes | <input type="checkbox"/> 人文關懷課程(Humanities Caring) <input type="checkbox"/> 競賽專題課程(Competition) <input type="checkbox"/> 問題導向課程(Problem-solving) <input checked="" type="checkbox"/> 專題導向課程(Project-based) <input type="checkbox"/> 實作課程(Practice-based) <input type="checkbox"/> 總整課程(Capstone) | | |
| 教材編選 Teaching materials | <input checked="" type="checkbox"/> 自製簡報(self-made PPTs) <input checked="" type="checkbox"/> 課程講義(Teaching Notes) <input type="checkbox"/> 自編教科書(self-made textbooks) <input checked="" type="checkbox"/> 教學程式(programming) <input type="checkbox"/> 自製教學影片(self-made video) <input type="checkbox"/> 其他(Others) | | |
| 教學資源 Teaching Resources | <input checked="" type="checkbox"/> 課程網站(Website) <input type="checkbox"/> 實習網站(Intern Web) <input type="checkbox"/> 教材電子檔供下載(Downloadable Files) | | |

| | | | | |
|---------------------------------|---|-----|-----------------|-----|
| 教科書/參考書 Textbooks/References | 「SAS－財金計量之應用」，王萬成著。新陸書局出版， ISBN：9789866333835。 | | | |
| 評量方式(請填百分比) Assessment | 課堂參與 Participation | 20% | 個案討論 Case study | % |
| | 作業 Homework | % | 專題 Project | 50% |
| | 小考 Quiz | 10% | 其他 1 other () | % |
| | 期中考 Midterm | 20% | 其他 2 other () | % |
| | 期末考 Final | % | 其他 3 other () | % |
| | 報告 Presentation | % | 其他 4 other () | % |

課程規劃表 Course Schedule

| 週次 week | 日期 Date | 內容 Description |
|------------|------------|--|
| 1. | 02/26 | 課程簡介、SAS 軟體安裝說明 |
| 2. | 03/05 | SAS 操作界面、路徑宣告、Data Step 與 SAS PDV |
| 3. | 03/12 | Import data (excel, text, CSV) 、變數格式轉換、合併資料、條件句 |
| 4. | 03/19 | 資料處理混合實作 -- proc rank, proc univariate, 加權平均, 調整後市場報酬、Portfolio Analysis |
| 5. | 03/26 | TEJ 資料清洗 |
| 6. | 04/02 | 清明連假 |
| 7. | 04/09 | TEJ 資料清洗 II |
| 8. | 04/16 | 期中考 |
| 9. | 04/23 | 期中考檢討、敘述統計量、相關係數矩陣、極端值處理、迴歸分析 (教學 paper 的敘述統計量要出來，含主要變數，可小樣本) |
| 10. | 04/30 | 教學 FA01_Ohlsoln (1980) & FA02_Lakonishok et al. (1994) |
| 11. | 05/07 | 教學 FA03 & FA04_Gaspar et al. (2005) |
| 12. | 05/14 | 教學 FA05_Livnat et al. (2019) & FA06_Liu (2006) |
| 13. | 05/21 | 教學 FA07_Cremers and Petajisto (2009) & FA08_Chordia et al. (2003) |
| 14. | 05/28 | ODS output Transpose, FEs, 固定效果、內生性問題、 |
| 15. | 06/04 | 期末報告-研究結果 I |
| 16. | 06/11 | 期末報告-研究結果 II |
| 17. | 06/18 | 自主學習 |
| 18. | 06/25 | 自主學習 |