

## 授課大綱

2020/02/23

課程名稱：財務預測

課程編號：5154661 (01)

上課時間：星期二 4, 5, 6 節 (10:10 – 13:00) 上課教室：電算中心 217 教室<sup>註1</sup>

授課老師：賴靖宜（財務金融學系暨研究所，管理學院 340，分機 24210）

Office Hour：星期四 13:00 – 14:00，其它時間請 email 確認

參考教材：Benninga, *Financial Modeling*, 4<sup>th</sup> ed., The MIT Press, 2014

McGuigan, Moyer, and Harris, *Managerial Economics*, 14<sup>th</sup> ed., Thomson South-Western, 2017

Hanke and Wichern, *Business Forecasting*, 9<sup>th</sup> ed., Pearson Prentice Hall, 2008

評分標準：上課出席率、課程參與程度 (50%)，作業 (50%)<sup>註2</sup>

教學目的：本課程旨在教授並訓練學生利用 Excel 建立「財務模型」，並進而擁有執行預測的能力。預期學生在本課程中，能學習將過去所學之財務理論與電腦軟體的實務操作做一適當的結合與運用。

預定授課進度：<sup>註3</sup>

| 日期              | 週次   | 授課內容 <sup>註4</sup>                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
|-----------------|------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 2/23            | 1    | Introduction                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |
|                 |      | ■ <b>Corporate Finance Models</b>                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
| 3/2,9,16,23     | 2-5  | <b>Basic Financial Calculations</b><br>Present value and Net present value, Internal rate of return (IRR) and Loan tables, Multiple internal rates of return, Flat payments schedules, Future values and applications, Pension problems, Continuous compounding, Discounting using dated cash flows<br><br>◦ Assignment 1 ◦ |
| 3/30; 4/6,13,27 | 6-10 | <b>Financial Statement Modeling</b><br>How financial models work, Free cash flow, Firm and equity evaluating, Sensitive analysis, Incorporating a target Debt/Equity ratio into a Pro forma, Project finance: Debt repayment schedules, Calculating the Return on Equity (ROE)<br><br>◦ Assignment 2 ◦                      |
| 4/20            | 9    | 4/19-25 期中考週（停課）<br><br>■ <b>Quantitative Forecasting Methods</b>                                                                                                                                                                                                                                                           |

|              |       |                                                                                                                                 |
|--------------|-------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 5/4,11,18,25 | 11-14 | <b>The Basic Models</b><br>Naïve, Simple average, Moving average, Model evaluation<br>Exponential smoothing, Tracking signals   |
| 6/1,8,15     | 15-17 | <b>The Advanced Models</b><br>Smoothing methods with trends and seasonality<br>Holt's Method, Winter's Method, Nonlinear models |
| 6/22         | 18    | <b>6/19-25 期末考週（停課）</b><br>◦ <i>Assignment 3</i> ◦                                                                              |

註 1：本課程的軟體需求為 Microsoft Excel（2013 以上版本）；軟體操作將於課堂中示範，並同步於電算中心電腦操作。

註 2：指定作業請於規定時間內繳交；遲交以一週為限，分數調整為原始總分之 80%。回家作業建議以分組報告呈現，惟每組組員需少於 3 名（含）。課間作業則個別於下課前 e-mail 至 eCourse2，並視為出席之重要紀錄。

註 3：實際授課內容依授課進度調整。

註 4：上課講義（精簡版）擬於逐堂授課前上傳至 eCourse2 教學課程系統供同學下載參考。