國立台灣科技大學 114學年 第2學期　課程大綱

Spring 2026 NTUST Course Outline

授課教師：簡憶茹

Instructor:Yi-Ju Chien

課程名稱：AI人工智慧與投資決策分析

Course Title：AI and Investment Decision Analytics

2026/11/3

課程代號：FN7502701 Course Code 學分數：3 Credits	必選修：選修/半學年 Required/Electve:Elective/Half Yr. 先修課程： Prerequisites

節次教室： Time/Location	RA(系上安排) RB(系上安排) RC(系上安排) TA(系上安排) TB(系上安排) TC(系上安排)
專業核心能力： Core Professional Competencies	·具備投資學與資產配置的核心知識，能理解風險與報酬的平衡原則。 ·能運用股票研究方法（自總體至個股）進行產業與公司分析。 ·能整合理論與實務，設計投資組合並評估其績效與風險。 ·具備以AI輔助投資判斷與資料分析能力，理解在決策中的應用價值。 ·具備專業報告撰寫與投資簡報表達能力。
課程網址： Course Website	
課程宗旨： Course Objectives	本課程旨在奠定學生對投資理論與資產配置的基礎，並進一步探討人工智慧在投資決策與投資組合建構中的應用。 課程內容涵蓋現代投資組合理論（Modern Portfolio Theory）、CAPM、因子投資、風險與報酬分析等核心概念，同時結合AI與機器學習模型，用以分析市場資料、建立投資策略與優化投資組合。學生將透過理論講解、資料實作與案例討論，學習在不同市場情境下運用AI輔助投資判斷與風險控管。
課程大綱： Outline of Lectures	講題一:AI時代的投資環境與工具 講題二:股權評價之方法論建立 講題三:股權評價與債權評價 講題四:個股研究之投資組合功能與風險 講題五:投資心理與決策紀律 講題六:AI協助資訊解讀:說法、情緒、敘事與資金流 講題七:因子投資與AI驅動策略和投資組合調整 講題八:AI驅動ETF策略探討與總結
授課方式： Method of Instruction	講授 Lecture：% 分組討論 Group discussion：% 案例研討 Case study：% 操做練習 Practical exercises：% 講授 Lecture：%
教科書： Textbooks	
參考書目： References	
修課須知： Notice	

評量方式： Grading
備註說明： Notes