

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

2026/6/22

課程代號： FN7502701 Course Code 學分數： 3 Credits	必選修：選修/半學年 Required/Elective: Elective/Half Yr. 先修課程： Prerequisites
節次教室： RA(IB-511-2) RB(IB-511-2) RC(IB-511-2) TA(IB-511-2) TB(IB-511-2) TC(IB-511-2) Time/Location	
專業核心能力： <ul style="list-style-type: none"> · 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。 Core Professional Competencies	
課程網址： Course Website	
課程宗旨： <p>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。</p> Objectives <p>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。</p>	
課程大綱： <p>Outline of Lectures</p> <ul style="list-style-type: none"> 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： <p>Method of Instruction</p> <ul style="list-style-type: none"> 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