

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  
(待)

Instructor:

課程名稱：AI人工智慧與投資  
決策分析

Course Title : AI and Investment  
Decision Analytics

2026/5/6

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"> <li>· 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。</li> <li>· 能運用股票研究方法（自總體至個股）進行產業與公司分析。</li> <li>· 能整合理論與實務，設計投資組合並評估其績效與風險。</li> <li>· 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。</li> <li>· 具備專業報告撰寫與投資簡報表達能力。</li> </ul> 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> <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> Course Objectives	
課程大綱： <ul style="list-style-type: none"> <li>講題一: AI時代的投資環境與工具</li> <li>講題二: 股權評價之方法論建立</li> <li>講題三: 股權評價與債權評價</li> <li>講題四: 個股研究之投資組合功能與風險</li> <li>講題五: 投資心理與決策紀律</li> <li>講題六: AI協助資訊解讀: 說法、情緒、敘事與資金流</li> <li>講題七: 因子投資與AI驅動策略和投資組合調整</li> <li>講題八: AI驅動ETF策略探討與總結</li> </ul> Outline of Lectures	
授課方式： <ul style="list-style-type: none"> <li>講授 Lecture：%</li> <li>分組討論 Group discussion：%</li> <li>案例研討 Case study：%</li> <li>操做練習 Practical exercises：%</li> <li>講授 Lecture：%</li> </ul> Method of Instruction	
教科書： Textbooks	
參考書目： References	
修課須知： Notice	

評量方式：  
Grading

備註說明：  
Notes