

## 课程大纲

### 金融市场与投资组合管理研究生文凭

#### Postgraduate Diploma in Financial Markets and Portfolio Management (PgDip in FMPM)

完成「校内工作坊」，十门必修课及「专案」，并通过评核者，可获颁发「金融市场与投资组合管理研究生文凭」。

1	<p><b>校内工作坊</b> Residential Workshop</p>
2	<p><b>宏观经济与投资市场分析</b> Macroeconomics and Investment Analysis</p> <p>主要内容：</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• 宏观经济理论</li> <li>• 经济环境与企业发展</li> <li>• 货币制度</li> <li>• 经济周期与投资分析</li> <li>• 前沿金融发展</li> </ul> <p>学员获益：</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• 阐述和解释主要宏观经济理论；</li> <li>• 解释企业于当前经济环境中其发展策略方针与措施；</li> <li>• 分析货币制度与政策如何影响经济运作及外汇交易；</li> <li>• 在不同的经济周期环境中作出合适的投资安排；</li> <li>• 应用前沿投资原则、现代经济财务模型，为投资者剖析市场状况，并制定和改进其投资战略方向。</li> </ul>
3	<p><b>投资组合管理量化工具</b> Quantitative Methods in Portfolio Management</p> <p>主要内容：</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• 基本投资数据：单项投资</li> <li>• 风险收益关系及其分配</li> <li>• 投资组合理论的均值和方差</li> <li>• 有效投资组合</li> <li>• 资本资产定价模型</li> <li>• 融资管理</li> </ul>

	<p>学员获益：</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• 运用数量模型和电脑软件 (Excel)，整理归纳科学量化数据；</li> <li>• 根据科学量化数据，利用相关分析比较投资组合的表现；</li> <li>• 运用投资理论，严谨地分析投资组合的收益和风险关系；</li> <li>• 结合前沿知识和理论模型，设计有效的投资组合；</li> <li>• 运用财经数据和量化财务模型来分析公司的融资管理。</li> </ul>
4	<p><b>股票与固定收益分析 Equity and Fixed Income Analysis</b></p> <p>主要内容：</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• 全球股票市场的发展趋势</li> <li>• 股票增值来源的分析</li> <li>• 股票估值的方法-基本分析</li> <li>• 固定收益证券概述和特性</li> <li>• 债券估价方法</li> <li>• 利率变化与债券收益曲线</li> <li>• 股票和债券的发行</li> </ul> <p>学员获益：</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• 整合应用股票和固定收益证券的原理和实际经验，深入探讨其重要的关键因素；</li> <li>• 分析市场变化对股票的影响，对股票的价值做出合理的评估和预测；</li> <li>• 对固定收益证券做出估价；</li> <li>• 预测利率变动，并对股票和固定收益证券的利率风险做出相关管理；</li> <li>• 在特定风险下，选择合适的股票债券投资组合。</li> </ul>
5	<p><b>衍生金融工具及交易策略 Derivatives and Trading Strategies</b></p> <p>主要内容：</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• 衍生金融工具对金融市场发展的影响</li> <li>• 衍生金融工具市场的运作机制</li> <li>• 利用期货的对冲策略</li> <li>• 衍生金融工具分析</li> <li>• 交易策略</li> </ul> <p>学员获益：</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• 充份解析衍生金融工具在金融市场的作用和策略；</li> </ul>

	<ul style="list-style-type: none"> <li>• 站在投资者及发行者的不同角度，应用衍生金融工具的特性，拟定投资组合；</li> <li>• 根据衍生金融工具的策略，进行数据分析，达致公司及个人投资目标；</li> <li>• 利用衍生金融工具模型，评估市场的变动，选择符合理财目标的投资组合；</li> <li>• 分析与区别各种金融交易策略及对冲基金交易策略之应用。</li> </ul>
6	<p><b>私募基金与创业投资 Private Equity and Venture Capital</b></p> <p>主要内容：</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• 私募基金和风投公司的内涵特征和发</li> <li>• 私募基金和风投公司的设立，募集过程和管理</li> <li>• 不同种类的基金分析</li> <li>• 私募基金的投资变现</li> <li>• 中国的私募基金和风投公司</li> </ul> <p>学员获益：</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• 全面剖析私募基金和风投公司的成立及发展；</li> <li>• 清晰地评估不同私募基金和风投公司的特征；</li> <li>• 审视私募基金和风投公司的募资过程；</li> <li>• 严谨评估私募基金和风投公司的投资价值；</li> <li>• 制定策略防范私募基金和风投公司的风险；</li> <li>• 阐述私募基金与风投的尽职调查原则与实施。</li> </ul>
7	<p><b>金融科技与人工智能算法 Financial Technology and Artificial Intelligence Algorithm</b></p> <p>主要内容：</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• 金融科技的基本概念</li> <li>• 金融科技的领域</li> <li>• 大数据</li> <li>• 人工智能算法</li> <li>• 发展与未来</li> </ul> <p>学员获益：</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• 阐述金融科技的发展趋势与金融智能化的模式；</li> <li>• 分析企业与社会当前面对的处境，筹划相应的智能化方案，帮助企业提高其运营效益；</li> </ul>

	<ul style="list-style-type: none"> <li>• 利用大数据和人工智能方案，以系统化方式作妥善的数据管理并提升交易系统的绩效；</li> <li>• 阐释人工智能算法的操作，理解交易员在人工智能实操的优势和盲点；</li> <li>• 解释金融科技与人工智能创新应用的机遇与困难，及行业的监管政策和措施。</li> </ul>
8	<p><b>绿色经济与 ESG 投资 Economy and ESG Investing</b></p> <p>主要内容：</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• 绿色经济</li> <li>• 绿色金融</li> <li>• 绿色建筑</li> <li>• ESG 发展</li> <li>• ESG 投资</li> </ul> <p>学员获益：</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• 解释绿色经济与社会及环境的相连关系；</li> <li>• 有效地运用不同绿色金融的融资方法以解决投资项目的资金需求</li> <li>• 阐述绿色建筑的行业发展原则并合理评估相关项目的投资价值；</li> <li>• 阐释 ESG 投资原理，并针对投资项目提出可行的 ESG 评估方式。</li> </ul>
9	<p><b>环球财富管理 Global Wealth Management</b></p> <p>主要内容：</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• 财富与投资管理概论</li> <li>• 投资目标与有效投资组合</li> <li>• 财富管理行业分析</li> <li>• 另类投资产品</li> <li>• 家族办公室概述</li> </ul> <p>学员获益：</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• 收集、分析及整合财务数据，从而制定符合个人、家族或企业的财富目标；</li> <li>• 透过收入支出和资产现状，为未来投资净资产做出分析；</li> <li>• 阐述家族办公室的市场发展；</li> <li>• 因应金融市场及投资目标的变动，调整并规划新的资产组合。</li> </ul>
10	<p><b>财富规划与传承 Wealth Planning and Succession</b></p> <p>主要内容：</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• 财富规划</li> </ul>

	<ul style="list-style-type: none"> <li>• 保险规划</li> <li>• 财富传承</li> <li>• 财富保全</li> <li>• 案例分析</li> </ul> <p>学员获益:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• 分析影响财富规划的因素;</li> <li>• 评估投资者的风险保障需求, 并设计合切的保险规划方案;</li> <li>• 严谨地评估投资者与其家族的财富传承与保全需求;</li> <li>• 综合财富规划原则, 阐释现代财富管理问题, 并提出合宜的建议方案。</li> </ul>
11	<p><b>投资风险管理与最优投资组合 Investment Risk Management and Portfolio Optimisation</b></p> <p>主要内容:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• 金融风险理论的概述</li> <li>• 典型的金融风险详述</li> <li>• 财务风险管理工具分析</li> <li>• 投资组合优化管理概述</li> <li>• 风险量化价值方法</li> <li>• 人性的风险管理 – 投资交易心理学</li> </ul> <p>学员获益:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• 评估常见的金融工具的各种风险, 做出相关的预测;</li> <li>• 深入分析不同金融工具的特性对风险管理的不同要求;</li> <li>• 将风险管理理论与最优化理论结合, 应用于投资组合中;</li> <li>• 量度及管理主要金融风险;</li> <li>• 评估利用期权作为风险管理策略可能遇到的问题。</li> </ul>
12	<p><b>专案 Final Project</b></p> <p>主要内容:</p> <p>学员将在不同单元中所学习到的知识融会贯通完成专案。</p> <p>第一节: 撰写小组专案建议书</p> <p>第二节: 专案咨询</p> <p>第三节: 提交小组专案报告 (专案报告中, 学员需要因应金融市场的发展, 拟定财务投资的目标, 规划投资组合行动方案并做出评估)。</p> <p>第四节: 口头专案汇报及点评</p>

学员获益:

- 将本课程所学知识，应用到金融市场实务中；
- 根据市场变动和实际情况，拟定合适的投资组合方案；
- 全面策划及执行投资组合方案，并评估方案的成效；
- 反思和学习在项目中所取得的经验，并阐述项目经验所带来的意义。

注：因应课程发展需要，学院保留调整课程内容的权利。