

课程大纲

金融市场与投资组合管理深造文凭(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「Postgraduate Diploma in Financial Markets and Portfolio Management」。

1	校内工作坊 Residential Workshop
2	宏观经济与投资市场分析 Macroeconomics and Investment Analysis 主要内容： • 宏观经济理论 • 经济环境与企业发展 • 货币制度 • 经济周期与投资分析 • 前沿金融发展 学员获益： • 阐述和解释主要宏观经济理论； • 解释企业于当前经济环境中其发展策略方针与措施； • 分析货币制度与政策如何影响经济运作及外汇交易； • 在不同的经济周期环境中作出合适的投资安排； • 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。
3	投资组合管理量化工具 Quantitative Methods in Portfolio Management 主要内容： • 基本投资数据：单项投资 • 风险收益关系及其分配 • 投资组合理论的均值和方差 • 有效投资组合 • 资本资产定价模型

	• 融资管理 学员获益： • 运用数量模型和电脑软件 (Excel)，整理归纳科学量化数据； • 根据科学量化数据，利用相关分析比较投资组合的表现； • 运用投资理论，严谨地分析投资组合的收益和风险关系； • 结合前沿知识和理论模型，设计有效的投资组合； • 运用财经数据和量化财务模型来分析公司的融资管理。
4	股票與固定收益投资组合管理 Equity and Fixed Income Portfolio Management 主要内容： • 全球股票市场的发展趋势 • 股票增值来源的分析 • 股票估值的方法-基本分析 • 固定收益证券概述和特性 • 债券估价方法 • 利率变化与债券收益曲线 • 股票和债券的发行 • 股债混合组合建构、优化与动态管理 学员获益： • 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； • 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； • 对固定收益证券做出估价； • 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； • 根据市场环境 with 特定风险限制，建构与优化相应的投资组合以达成资产管理目标。
5	衍生金融工具及交易策略 Derivatives and Trading Strategies 主要内容： • 衍生金融工具对金融市场发展的影响 • 衍生金融工具市场的运作机制 • 利用期货的对冲策略 • 衍生金融工具分析 • 交易策略

	学员获益： • 充份解析衍生金融工具在金融市场的作用和策略； • 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； • 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； • 利用衍生金融工具的模型，评估市场的变动，选择符合理财目标的投资组合； • 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。
6	私募基金与创业投资 Private Equity and Venture Capital 主要内容： • 私募基金和风投公司的内涵特征和发 • 私募基金和风投公司的设立，募集过程和管理 • 不同种类的基金分析 • 私募基金的投资变现 • 中国的私募基金和风投公司 学员获益： • 全面剖析私募基金和风投公司的成立及发展； • 清晰地评估不同私募基金和风投公司的特征； • 审视私募基金和风投公司的募资过程； • 严谨评估私募基金和风投公司的投资价值； • 制定策略防范私募基金和风投公司的风险； • 阐述私募基金与风投的尽职调查原则与实施。
7	金融科技与人工智能算法 Financial Technology and Artificial Intelligence Algorithm 主要内容： • 金融科技的基本概念 • 金融科技的领域 • 大数据 • 人工智能算法 • 发展与未来 学员获益： • 阐述金融科技的发展趋势与金融智能化的模式；



	• 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； • 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； • 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； • 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。
8	绿色经济与 ESG 投资 Economy and ESG Investing 主要内容： • 绿色经济 • 绿色金融 • 绿色建筑 • ESG 发展 • ESG 投资 学员获益： • 解释绿色经济与社会及环境的相连关系； • 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 • 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； • 阐释 ESG 投资原理，并针对投资项目提出可行的 ESG 评估方式。
9	环球财富管理 Global Wealth Management 主要内容： • 财富与投资管理概论 • 投资目标与有效投资组合 • 财富管理行业分析 • 另类投资产品 • 家族办公室概述 学员获益： • 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； • 透过收入支出和资产现状，为未来投资净资产做出分析； • 阐述家族办公室的市场发展； • 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。

10	财富规划与传承 Wealth Planning and Succession 主要内容： • 财富规划 • 保险规划 • 财富传承 • 财富保全 • 案例分析 学员获益： • 分析影响财富规划的因素； • 评估投资者的风险保障需求，并设计合切的保险规划方案； • 严谨地评估投资者与其家族的财富传承与保全需求； • 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。
11	投资风险管理与最优投资组合 Investment Risk Management and Portfolio Optimisation 主要内容： • 金融风险理论的概述 • 典型的金融风险详述 • 财务风险管理工具分析 • 投资组合优化管理概述 • 风险量化价值方法 • 人性的风险管理 – 投资交易心理学 学员获益： • 评估常见的金融工具的各种风险，做出相关的预测； • 深入分析不同金融工具的特性对风险管理的不同要求； • 将风险管理理论与最优化理论结合，应用于投资组合中； • 量度及管理主要金融风险； • 评估利用期权作为风险管理策略可能遇到的问题。
12	专案 Final Project 主要内容： 学员将在不同单元中所学习到的知识融会贯通完成专案。



第一节：撰写小组专案建议书

第二节：专案咨询

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)。

第四节：口头专案汇报及点评

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。