

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「“超越自我”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>开学典礼 暨 “超越自我”工作坊 Opening Ceremony cum “Excel Yourself” Workshop</p>
2	<p>金融市场与宏观经济分析 Macroeconomics and Financial Markets Analysis</p> <p>主要内容</p> <ul style="list-style-type: none"> • 金融市场、金融机构、金融交易产品 • 宏观经济分析 • 环球经济展望 • 金融市场的监管及企业管治 • 金融道德 <p>完成本单元后，学生能够：</p> <ul style="list-style-type: none"> • 有效利用国际经济数据，解释商业週期及经济对环球投资趋势影响； • 从不同角度剖析金融市场的运作，并全面评估金融市场的变动因素，以拟定企业及个人投资取向； • 应用前沿投资概念、国际经济财务基本理论和模型，为企业及个人剖析市场状况； • 运用经济与投资理论，严谨地评估投资组合的收益和风险关系。 • 根据国际金融机构的改革经验，制定和改进企业投资战略方向。

<p>3</p>	<p>投资组合管理量化工具 Quantitative Methods in Portfolio Management</p> <p>主要内容</p> <ul style="list-style-type: none"> • 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 <p>完成本单元后，学生能够：</p> <ul style="list-style-type: none"> • 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； • 运用财经资料和量化财务模型来分析公司的融资管理。
<p>4</p>	<p>股票与固定收益分析 Equity and Fixed Income Analysis</p> <p>主要内容</p> <ul style="list-style-type: none"> • 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 <p>完成本单元后，学生能够：</p> <ul style="list-style-type: none"> • 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；

	<ul style="list-style-type: none"> • 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； • 在特定风险下，选择合适的股票债券投资组合。
5	<p>衍生金融工具及交易策略 Derivatives and Trading Strategies</p> <p>主要内容</p> <ul style="list-style-type: none"> • 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 <p>完成本单元后，学生能够：</p> <ul style="list-style-type: none"> • 充份解析衍生金融工具在金融市场的作用和策略； • 站在投资者及發行者的不同角度，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式，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	<p>私募基金与创业投资 Private Equity and Venture Capital</p> <p>主要内容</p> <ul style="list-style-type: none"> • 私募基金和风投公司的内涵特征和发展 • 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 <p>完成本单元后，学生能够：</p> <ul style="list-style-type: none"> • 全面剖析私募基金和风投公司的成立及發展； • 清晰地评估不同私募基金和风投公司的特徵； • 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；

	<ul style="list-style-type: none"> • 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	<p>金融科技创新与实践 Fintech Innovations and Applications</p> <p>主要内容</p> <ul style="list-style-type: none"> • 金融科技的引进 • 金融科技的商业模式 • 金融科技应用 • 金融科技发展与规管 <p>完成本单元后，学生能够</p> <ul style="list-style-type: none"> • 有效分析金融科技的出现对商业模式的转变及影响； • 严谨地评估区块链对金融行业發展带来的影响； • 系统性地评估金融科技的主要应用范畴及为金融业引进的机遇； • 辨识金融科技所需的技术及工具，并物色合适的人选以提供有效解决方案； • 剖析金融科技的当前监管与限制和未来發展趋势。
8	<p>房地产投资与信托基金 Real Estate Investment and REITs</p> <p>主要内容</p> <ul style="list-style-type: none"> • 环球主要房地产投资市场分析 • 房地产市场融资 • 房地产市场证券化及房托投资 • 房地产股票投资 • 房地产市场风险管理 • 综合个案分析 <p>完成本单元后，学生能够</p> <ul style="list-style-type: none"> • 解释主要房地产市场与经济环境的相连关系； • 有效地运用不同的房地產市场融资方法以解决房地產项目的资金需求； • 深入分析房地产证券化项目及房地产信託投资； • 评估房地產项目的风险，并提出可行的风险防控策略；

	<ul style="list-style-type: none"> 系统地分析房地产上市公司的股票: 回报、估值与风险。
9	<p>金融数据分析与决策 Financial Data Analysis and Decision</p> <p>主要内容</p> <ul style="list-style-type: none"> 金融数据挖掘 金融数据管理 策略编写分析与决策 案例分析 <p>完成本单元后，学生能够</p> <ul style="list-style-type: none"> 应用数据管理原理有效处理金融数据； 阐述不同金融数据分析方式的优劣处； 以系统化数据处理方式分析金融市场和财经环境数据，并作出合理的投资决策与安排； 利用金融数据资讯得出合理分析结论并筛选出最优投资策略。
10	<p>环球财富管理 Global Wealth Management</p> <p>主要内容</p> <ul style="list-style-type: none"> 财富与投资管理概论 财富的创造及保障 投资组合策略与投资目标 有效投资组合 交易型开放式指数基金介绍 投资组合的风险管理及表现 综合个案分析及当代财富管理问题 <p>完成本单元后，学生能够</p> <ul style="list-style-type: none"> 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，为未来投资淨资产做出分析； 批判性地评价当代财富管理问题，建立合适风险程度的投资组合； 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。

<p>11</p>	<p>金融市场风险管理 Risk Management in Financial Markets</p> <p>主要内容</p> <ul style="list-style-type: none"> • 国际金融市场风险的概览和趋势 • 各种金融风险描述 • 财务风险管理工具分析 • 利用财务风险管理工具对冲风险 • 风险量化价值方法 • 风险管理案例分析 <p>完成本单元后，学生能够</p> <ul style="list-style-type: none"> • 从不同角度深入剖析金融风险对公司及个人投资的影响，并运用于实际案例； • 评估常见的金融工具的各种风险，做出相关的预测； • 对利用期权及期货管理财务风险的不同战略进行更深入的研究，评估采取有关战略的问题及难题； • 在中国金融市场持续发展和人民币在环球资本市场地位日益提升的进程中，分析必要的金融财务风险； • 协助金融风险专业团队，提高应用型研究能力，达致有效的风险管理。
<p>12</p>	<p>专案 Final Project</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：撰写项目建议书</p> <p>第二节：专案咨询，口头演示及演示文稿</p> <p>第三节：提交最后报告 (专案报告中, 学员需要因应金融市场的發展，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>完成本单元后，学生能够</p> <ul style="list-style-type: none"> • 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；

- | |
|--|
| <ul style="list-style-type: none">• 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。