

投资模拟

课程编号： 02802110

授课对象：金融学硕士

学 分： 2

任课教师：赵龙凯、张峥

课程类型： 选修

开课学期： 2014 春

先修课程： 财务分析应用、金融 I、金融 II

任课教师联系方式：

辅导、答疑时间：

一、 项目培养目标

学习目标 1 教授学生最新的金融学、经济学和管理学的理论知识，培养学生综合运用理论知识和解决实际金融问题的能力。

具体目标 1 系统掌握金融学、经济学和管理学的理论知识

具体目标 2 掌握数量化与分析问题的能力

具体目标 3 能够综合应用所学的理论知识和方法解决实际问题

学习目标 2 培养学生良好的沟通能力，使之适应在各类金融机构和企业的工作。

具体目标 1 具备良好的口头交流

具体目标 2 具备良好的书面交流能力

具体目标 3 具备良好的团队合作精神

学习目标 3 具有良好的社会责任感和伦理道德观

学习目标 4 具有国际化的视野

具体目标 1 理解金融的商业环境存在文化差异

具体目标 2 了解全球不同的金融体系

具体目标 3 适应在跨国金融机构有效工作。

二、课程概述

《投资模拟》通过讲授实务投资中各个行业的投资分析方法和框架，在模拟的证券投资决策环境中，培养学生理论的实务应用能力，积累金融务实经验。课程内容包括金融工具的价值评估、各个行业的分析方法、投资组合管理等。本课程的基础是财务报表分析和证券投资学。

三、课程目标（包括学生所提高的技能要求），本课程目标如何服务于项目的培养目标

第一，教授学生最新的行业投资分析理论和方法；第二，培养学生系统掌握金融学、经济学和管理学的理论知识；第三、培养学生综合应用所学的理论知识和方法

法解决实际问题的能力。

四、内容提要及学时分配

	内容	周	方式
第 1 部分	投资管理概述 行业分析方法（一）	1	讲授
第 2 部分	行业策略讨论（一）	2	讨论
第 3 部分	行业分析方法（二）	3	讲授
第 4 部分	行业策略讨论（二）	4	讨论
第 5 部分	行业分析方法（三）	5	讲授
第 6 部分	行业策略讨论（三）	6	讨论
第 7 部分	行业分析方法（四）	7	讲授
第 8 部分	行业策略讨论（四）	8	讨论
第 9 部分	行业分析方法（五）	9	讲授
第 10 部分	行业策略讨论（五）	10	讨论
第 11 部分	策略总结	11	汇报

注：可能涉及的行业包括银行与非银行金融机构、机械、医药生物、房地产、农林牧渔、煤炭、电子、家电、食品饮料、传播与文化等等。

五、教学方式

课堂讲授+策略讨论

六、教学过程中 IT 工具等技术手段的应用

七、教材

课程讲义

八、参考书目

Elton, Edwin J., Martin J. Gruber, et.al., Modern Portfolio Theory and Investment Analysis. Hoboken, NJ: John Wiley & Sons, Inc.

九、教学辅助材料，如 CD、录影等

十、课程学习要求及课堂纪律规范

分组：学生 3 人一组，以组为单位进行投资分析。

考勤：学生必须按时参加所有课程。

课堂讨论：鼓励学生积极参加讨论。

分析报告：每组每周完成策略分析报告。

十一、学生成绩评定办法（需详细说明评估学生学习效果的方法）

课堂参与： 30%

分析报告： 70%

十二、项目培养目标的考核方式与标准（仅适用于参与保障教学效果评估 (Assurance of Learning) 的课程，该部分可以由教务部门与任课老师沟通后填写，认证涉及课程：金融学概论、金融计量经济学 II、证券投资学、实证金融、货币金融理论、金融工程、管理学、微观经济学)