

课程大纲

课程编号: 02812510

授课对象: 11 金融硕士

课程名称: 动态投资组合管理

英文名称: Dynamic Portfolio Management

周学时/总学时: 3/36

学 分: 2

任课教师: 路磊

开课学期: 2012 年秋

先修课程: 投资学, 微观经济学

任课教师联系方式: 电话: 62767227; Email: leilu@gsm.pku.edu.cn

辅导、答疑时间: 待定

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

In this course we will examine the investment strategies by professional investors, the emphasis will be placed on the asset allocation and portfolio construction. The topics include equity analysis and portfolio management, bond analysis and portfolio management, and global investing.

三、课程目标 (包括学生所提高的技能要求)

The objective of the course is to understand how the professional investors use the

theory to the real investment. To succeed in this course, students must have both **good economic intuition and quantitative skills**.

四、内容提要及学时分配

Sep. 12, Introduction

Sep. 19/26, Oct/10/17, Equity analysis and portfolio management

Oct 24/31, Nov. 7, Bond analysis and portfolio management

Nov. 14, Global investing

Nov. 21, Exam

五、教学方式

六、教学过程中 IT 工具等技术手段的应用

PPT slides

七、教材

Frank Fabozzi, Harry Markowitz, *The Theory and Practice of Investment*

Management: Asset Allocation, Valuation, Portfolio Construction, and Strategies,
2nd edition, 2010

Scott Stewart, Christopher Piro, and Jeffrey Heisler, *Running Money: Professional Portfolio Management*, 1st edition, 2010.

八、参考书目

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

课前认真阅读教材和文章。

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）

课后作业 30%

期末考试（闭卷） 70%