

课程大纲

投资模拟

课程编号：02802110

学 分：2

课程类型：选修

先修课程：财务分析应用、金融 I、金融 II

授课对象：金融硕士

任课教师：张峥、赵龙凯

开课学期：2015 年春

任课教师简历（500 字左右）：

张峥博士现任北京大学光华管理学院金融学副教授。他 1995 年毕业于南开大学，获应用数学学士学位；1998 年毕业于南开大学，获应用数学硕士学位。2005 年毕业于北京大学，获金融学博士学位。他的研究领域为证券投资、风险管理和行为金融。他现在教授的课程有金融工程、金融衍生工具、金融建模和实证金融。



赵龙凯现任北京大学光华管理学院金融系副教授。他本科就读于清华大学经济系，后分别在新加坡国立大学和加拿大英属哥伦比亚大学获得金融硕士和博士学位。

他在国内外的学术期刊上发表了多篇学术论文。目前他的研究兴趣主要在于 Theoretical and empirical corporate finance, Investment, Asset pricing, Derivatives.



任课教师联系方式：

张峥老师：zheng86@gsm.pku.edu.cn

赵龙凯老师：lzhao@gsm.pku.edu.cn

助教姓名及联系方式：

辅导、答疑时间：

一、项目培养目标

Program objective 1 Introducing frontier theories of finance, economics, and management; helping students establish the ability to apply theoretical knowledge and solve real world financial problems.

Specific objectives include

- Obtaining systematic understanding of finance, economics, and management theories;
- Mastering quantitative analysis skills;
- Applying theoretical knowledge in class to real problems.

Program objective 2 Building strong communication skills to help students work in financial institutions and companies. Specific objectives include

- Fostering strong oral communication skills;
- Fostering effective written communication skills;
- Building team work spirits.

Program objective 3 Establishing social responsibility and business ethics.

Program objective 4 Gaining an international perspective. Specific objectives include

- Understanding the cultural variety in the financial industry;
- Knowing different financial systems around the world;
- Preparing for effective work at multinational financial institutions.

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

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。

期末考试时间：

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：鼓励学生积极参与讨论。

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%