

课程详述

COURSE SPECIFICATION

以下课程信息可能根据实际授课需要或在课程检讨之后产生变动。如对课程有任何疑问，请联系授课教师。

The course information as follows may be subject to change, either during the session because of unforeseen circumstances, or following review of the course at the end of the session. Queries about the course should be directed to the course instructor.

1.	课程名称 Course Title	证券投资实操 Securities Investment Practicum				
2.	授课院系 Originating Department	金融系 Department of Finance				
3.	课程编号 Course Code	FIN214				
4.	课程学分 Credit Value	1				
5.	课程类别 Course Type	专业选修课 Major Elective Courses				
6.	授课学期 Semester	春季 Spring				
7.	授课语言 Teaching Language	中文 Chinese				
8.	授课教师、所属学系、联系方式 (如属团队授课, 请列明其他授课教师) Instructor(s), Affiliation & Contact (For team teaching, please list all instructors)	徐睿, 国信证券交易服务组产品经理, 香港科技大学博士, 18665950482 Mr.Xu Rui, Manager of Product in Transaction Services Department of Guosen, PhD in Hong Kong University of Science and Technology Tel:18665950482				
9.	实验员/助教、所属学系、联系方式 Tutor/TA(s), Contact	无 N/A				
10.	选课人数限额(可不填) Maximum Enrolment (Optional)					
11.	授课方式 Delivery Method	讲授 Lectures	习题/辅导/讨论 Tutorials	实验/实习 Lab/Practical	其它(请具体注明) Other (Please specify)	总学时 Total
	学时数			32		32

Credit Hours

--	--	--	--	--

12.	先修课程、其它学习要求 Pre-requisites or Other Academic Requirements	无 N/A
13.	后续课程、其它学习规划 Courses for which this course is a pre-requisite	无 N/A
14.	其它要求修读本课程的学系 Cross-listing Dept.	无 N/A

教学大纲及教学日历 SYLLABUS

15. 教学目标 Course Objectives

本课程主要学习证券投资分析与量化交易的基础知识与核心理念、基础交易规则、主流策略的原理及实现过程、量化交易平台的使用，并通过实训课程提供了解金融行业（包括券商）与交易策略研发的实践机会。

In this course, students will be familiarize themselves with core concepts and fundamental knowledge and rules on securities investment analysis, quantitative trading, underlying transaction major strategy theory and operation, application of quantitative trading platforms and practices in trading strategy development as well as financial practicums (including practices of securities traders).

16. 预达学习成果 Learning Outcomes

通过本课程学习，使学生进一步加深对证券投资的理理解，基本具备在证券投资与量化交易相关岗位实习或工作的基础技能。

Students will be able to deepen their understandings on securities investment and master basic skills in securities investment and quantitative trading for their internships and career development.

17. 课程内容及教学日历（如授课语言以英文为主，则课程内容介绍可以用英文；如团队教学或模块教学，教学日历须注明主讲人）

Course Contents (in Parts/Chapters/Sections/Weeks. Please notify name of instructor for course section(s), if this is a team teaching or module course.)

第 1 次：走进证券行业（介绍金融市场及证券行业反转，证券公司的主要业务）（2 学时）

第 2 次：如何进行证券投资（股票交易软件使用、行情数据、K 线如何产生、证券行情分析）（2 学时）

第 3 次：证券投资发展与主流投资方法（技术派、价值派、量化投资（高频交易））（2 学时）

第 4 次：基本面投资分析（基本面研究的基本要素和通用框架）（2 学时）

第 5 次：技术分析方法及均线系统介绍（2 学时）

第 6 次：技术分析方法——波浪理论介绍（2 学时）

第 7 次：市场交易品种与交易规则介绍（2 学时）

第 8 次：如何进行个人理财——认识基金与基金定投（2 学时）

第 9 次：各种类型订单介绍与交易执行方法（2 学时）

第 10 次：投资效果评价和交易风险控制（2 学时）

第 11 次：金融科技与量化交易入门（2 学时）

第 12 次：Python 基础（2 学时）

第 13 次：Python 进阶与国信 iQuant 策略交易平台介绍（2 学时）

第 14 次：策略开发实战——多因子交易策略与机器学习交易策略（2 学时）

第 15 次：技术分析方法——波浪理论介绍（2 学时）

第 16 次：实训课——学生分组答辩（视课程人数，2~3 人一组）（2 学时）

Lesson 1: Securities as an Industry (Introduction to Financial Market, Security Industries Reversal and Major Services of Securities Company) (2 hours)

Lesson 2: Methodology for Securities Investment (Relevant Software, Data Analysis, Basics of K-Line, Analysis of Securities Markets) (2 hours)

Lesson 3: Development of Securities Investment and Major Methods for Investment (Technology, Values and Quantitative Trading Aspects (High-frequency Trading)) (2 hours)

Lesson 4: Investment Fundamentals Analysis (the Elements and Frames for Analysis) (2 hours)

Lesson 5: Technological Analysis Methods and Introduction to Equal String Arrangement System (2 hours)

Lesson 6: Technological Analysis Method: Wave Theory (2 hours)

Lesson 7: Market Transactions and the Rules (2 hours)

Lesson 8: Personal Financial Management: Funds and Fixed Investment in Funds (2 hours)

Lesson 9: Order Forms and Trading Methods (2 hours)
Lesson 10: Effect Evaluation in Investment and Trading Risk Control (2 hours)
Lesson 11: Basics on Financial Science and Quantitative Trading (2 hours)
Lesson 12: Basics on Python (2 hours)
Lesson 13: Advanced Learning of Python and Introduction of Guosen iQuant Strategic Transaction Platform (2 hours)
Lesson 14: Practicum in Strategy: Multi-factor Trading Strategies and Machine-learning Trading Strategies (2 hours)
Lesson 15: Technological Analysis Method: Introduction of Wave Theory (2 hours)
Lesson 16: Practical Training : Oral Defense in Groups (2 or 3 Students in Each Group) (2 hours)

18. 教材及其它参考资料 Textbook and Supplementary Readings

《程序化交易初级教程》，高教社，陈学彬
《程序化交易中级教程》，复旦大学出版社，陈学彬
《程序化交易高级教程》，高教社，陈学彬
The Elementary Course for Programming Trading, Chen Xuebin Higher Education Press
The Immediate Course for Programming Trading, Chen Xuebin Fudan University Press
The Advanced Course for Programming Trading, Chen Xuebin Higher Education Press

课程评估 ASSESSMENT

19. 评估形式 Type of Assessment	评估时间 Time	占考试总成绩百分比 % of final score	违纪处罚 Penalty	备注 Notes
出勤 Attendance				
课堂表现 Class Performance				
小测验 Quiz				
课程项目 Projects				
平时作业 Assignments				
期中考试 Mid-Term Test				
期末考试 Final Exam				
期末报告		100		

Final Presentation
其它（可根据需要
改写以上评估方
式）
**Others (The
above may be
modified as
necessary)**

20. 记分方式 **GRADING SYSTEM**

- A. 十三级等级制 **Letter Grading**
 B. 二级记分制（通过/不通过） **Pass/Fail Grading**

课程审批 REVIEW AND APPROVAL

21. 本课程设置已经过以下责任人/委员会审议通过
This Course has been approved by the following person or committee of authority

