

## 课程大纲 COURSE SYLLABUS

1.	<b>课程代码/名称</b> Course Code/Title	投资学 Investment
2.	<b>课程性质</b> Compulsory/Elective	必修课 Compulsory
3.	<b>课程学分/学时</b> Course Credit/Hours	3/48
4.	<b>授课语言</b> Teaching Language	中文 Chinese
5.	<b>授课教师</b> Instructor(s)	李仲飞 Li Zhongfei
6.	<b>是否面向本科生开放</b> Open to undergraduates or not	否 No
7.	<b>先修要求</b> Pre-requisites	(如面向本科生开放, 请注明区分内容。 If the course is open to undergraduates, please indicate the difference.) 无 Non
8.	<b>教学目标</b> Course Objectives	
	(如面向本科生开放, 请注明区分内容。 If the course is open to undergraduates, please indicate the difference.) (1) 掌握金融投资的基本理念、理论 (2) 具有一定的金融投资决策分析能力 (3) 具有一定的操作、动手和创新的能力	
9.	<b>教学方法</b> Teaching Methods	
	(如面向本科生开放, 请注明区分内容。 If the course is open to undergraduates, please indicate the difference.) 讲授 Lecture	
10.	<b>教学内容</b> Course Contents	
	(如面向本科生开放, 请注明区分内容。 If the course is open to undergraduates, please indicate the difference.)	
	<b>Section 1</b>	投资组合选择的 风险-收益模型
	<b>Section 2</b>	投资组合选择的 Safety-First 模型
	<b>Section 3</b>	投资组合选择的 效用最大化模型
	<b>Section 4</b>	投资组合选择的 极大极小模型
	<b>Section 5</b>	投资组合选择的 交互式方法
	<b>Section 6</b>	投资组合选择的 Black-Litterman 方法
	<b>Section 7</b>	银行信贷配置的 复杂网络方法
	<b>Section 8</b>	资产-负债管理模型

	<b>Section 9</b>	资本资产定价理论
	<b>Section 10</b>	因子模型与套利定价理论
	<b>Section 11</b>	分布不确定下的投资组合选择方法
	<b>Section 12</b>	态度不确定下的投资组合选择方法
	<b>Section 13</b>	基于机器学习的投资组合选择
<b>11.</b>	<b>课程考核 Course Assessment</b>	
	<p>(① 考核形式 Form of examination; ②. 分数构成 grading policy; ③ 如面向本科生开放, 请注明区分内容。 If the course is open to undergraduates, please indicate the difference.)</p> <p>出勤 (10%) + 小论文 (20%) + 闭卷考试 (70%)</p>	
<b>12.</b>	<b>教材及其它参考资料 Textbook and Supplementary Readings</b>	
	<p>(1) 讲义 Lecture Notes (2) 论文 Papers</p>	