
投资学培训课程大纲

课程核心：投资学是对投资进行系统研究，确定如何把个人、机构的有限资源分配到诸如股票、国债、不动产等金融资产上，更科学地进行投资活动，以获得合理的现金流量和风险收益率。学会运用宏观经济分析判断外汇、黄金、原油、债券等各个市场走向，把握投资机会。

适用对象：交易所或银行交易部门中高层、交易员、总裁班、研修班、专题讲座、企业财务部、企业资金部等。

授课老师：荣森

授课时间：1天

授课地点：待定

课程大纲：

第一部分 投资综述

第一章 投资环境

1.1 投资定义

1.2 投资与融资

1.3 投资与金融机构（银行、证券、保险）

1.4 金融系统的客户

1.5 投资市场与投资结构

1.6 投资发展趋势

第二章 金融市场和金融工具

2.1 金融市场概况与金融市场运行

-
- 2.2 货币市场： 大额存单、货币基金
 - 2.3 外汇市场： 即期、远期、掉期、外汇衍生品与个人外汇投资
 - 2.4 固定收益资本市场：债券投资
 - 2.5 股权市场： 股权一级市场 PE/VC、股权二级市场 IPO、共同基金、对冲基金、私募基金等
 - 2.6 股票和债券市场指数：指数构成与 ETF 应用
 - 2.7 大宗商品市场： 原油、黄金市场及衍生品市场投资分析要点
 - 2.8 保险市场： 保险市场投资工具及投资要点分析

第二部分 投资组合和资本市场均衡理论

第三章 投资组合建立与管理的一般方法

- 3.1 投资组合管理逻辑
- 3.2 投资组合计划
- 3.3 投资组合执行
- 3.4 投资组合反馈
- 3.5 目标与限制条件

第四章 风险和风险厌恶

- 4.1 风险和风险厌恶
- 4.2 投资投资组合的风险

第五章 资产定价模型与最优投资组合

- 5.1 资产定价模型

5.2 分散化与资产组合

5.3 两种风险资产的资产组合

5.4 资产在股票、债券和外汇等不同资产类别之间的配置

5.5 马克维茨的资产组合选择模型

第六章 市场的有效性

6.1 随机漫步与有效市场假定

6.2 有效市场假定对投资政策的含义

6.3 市场是有效的吗

第三部分 投资的风险管理

第七章 投资中的风险管理

7.1 投资风险管理的过程

7.2 投资风险的种类：八大类风险

7.3 投资风险管理的方法：四种主要方法

第四部分 宏观经济分析与投资决策

第八章 宏观经济分析与投资决策

8.1 经济周期

8.2 全球经济

8.3 国内宏观经济

8.4 需求和供给

8.5 政府政策

8.6 利率与汇率

9.1 交流与互动