

# “智能量化与价值投资” 产教融合实验班

---

**信息管理学院**

# 一、“智能量化与价值投资”产教融合实验班的介绍

- 该实验班于2020年由信息管理学院优秀校友企业：凯丰投资有限公司与翼虎投资有限公司共同发起，每年3月份从全校新生中选报30人左右，归属数据科学与大数据技术专业。
- 办班目的：专业设置与企业需求对接、课程内容与企业标准对接、教学实践过程与企业运行过程对接，加快校企协同育人，培养更多德才兼备高素质新金融人才，扩大江西财经大学在金融、投资领域的影响力。

江财新闻：

<http://news.jxufe.edu.cn/news-show-120439.html>

凯丰投资荣获“2022中国金鼎奖·最受机构认可私募基金公司”奖项

<http://news.jxufe.edu.cn/news-show-120424.html>

翼虎投资斩获第六届“金阳光”奖杯



## 培养特色：

- (1) 专业实战演练

由企业导师亲自授课，将量化投资从数据清洗，到因子挖掘、策略研发，再到实盘交易的全流程寄于案例分析或实习实训，增强实践经验。

- (2) 实行“学术导师+企业导师”的双导师制、“项目+导师”团队制的灵活培养模式

课堂理论教学由学校导师讲授，实战化课程由企业导师按专题形式讲授，以每月一次讲座的形式完成，或在二阶段教学环节以集中授课的方式完成。



- (3) 理论学习与实习实训相结合的教学模式

实习分为专业课程实习和毕业实习两部分

大二、大三的专业课程实习，以企业委派工程师到学院进行线上虚拟价值投资实训或教师带学生前往企业实训的形式开展；

大四的毕业实习由企业根据前期表现选拔优秀学生进行岗前培训和推荐工作。

**第一届学生已经选拔10名同学前往凯丰投资、翼虎投资、松禾资本实习。**



## 实战课程：



第3-6学期共安排了4-6门企业导师课程

第3学期：[1004705052]价值投资分析

第4学期：[1004703553]现代金融工程、[1004705062]投资组合分析

第5学期：[1004704962]大数据采集实践、[1004705072]智能投资

第6学期：[1004701873]金融风险分析、[1004705082]全球战略投资分析



# 已开展的工作：

- 2023年7月8日在江西财经大学信息管理学院举行了“智能量化与价值投资”产教融合实验班2022级导师见面会暨2023级开班仪式。

- 已聘任余定恒（翼虎投资董事长）、  
吴星（凯丰投资董事长）、  
罗舟（海通证券企业金融部总经理）等  
16位企业导师为实验班授课教师。

期待更多的导师加入该实验班。

- 开幕式全程直播，并在中央广电总台国际在线、  
大江网、凤凰网等媒体进行了宣传报道

- <https://jx.cri.cn/20230710/aa669dec-de36-2b36-df32-549a6b122639.htm>  
<https://edu.jxnews.com.cn/system/2023/07/10/020141061.shtml>、<https://tt.m.jxnews.com.cn/news/2243221?app=jxttn&uid=156172&jxttn=>





- 7月9日翼虎投资董事长余定恒讲授第一堂课：价值投资的经律论
- 将中国古代哲学思想融入价值投资分析中，从经：心法、律：理念、论：战术的角度全面介绍价值投资的原理，分析了股票、指数、期货、期权的联系与区别，梳理了2008年到2022年世界局势演变对资本投资带来的影响，提出了慢即是快的投资理念，阐述了巴菲特、索罗斯、西蒙斯的量化投资理念，进而构建了由成长股、价值成长股、价值股构成的三维估值体系及其适用行业，最后对比分析了中国与日本、中国与美国的投资战术。



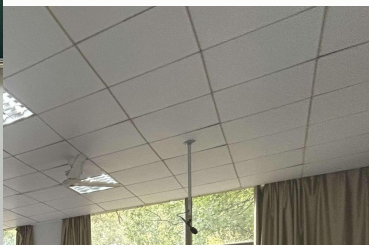


- 10月15日，原广发证券总监李长树讲述投资银行与企业融资，介绍了投资银行的分类、证券公司的一般架构，分析了投资银行业务中的融资业务、并购重组财务顾问业务，对比了直接融资与间接融资、外源融资与内源融资的不同，比较了各种债务融资方式，分析了股权融资的特点，介绍了企业融资流程—IPO的步骤及其每一步的注意事项。





- 10月28日，松禾资本合伙人冯华讲授了《如何作风险投资》，对比了各个行业特点及研究报告的撰写，分析了投资和创业实操过程，阐述了如何进行风险控制，并以实际投资案例的讲解分析了风险投资的全过程。





# 学生反馈：

## 学生希望持续开展下去，增加实战模拟，见识团队如何分工作战

第2题：你对导师们的授课内容是否满意？ [单选题]

选项	小计	比例
非常满意	35	59.32%
满意	23	38.98%
一般	1	1.69%
不满意	0	0%
本题有效填写人次	59	

饼状 圆环 柱状 条形 折线

第3题：你认为企业导师在课堂教学中能否做到化解难点、清晰透彻？ [单选题]

选项	小计	比例
做的非常好	33	55.93%
较好	24	40.68%
一般	2	3.39%
非常差	0	0%
本题有效填写人次	59	

饼状 圆环 柱状 条形 折线

第4题：你认为企业导师们在风险投资、量化投资以及理论联系实际方面做的如何？ [单选题]

第5题：通过企业导师讲解你是否对智能量化与价值投资方面有了更深入的认识？ [单选题]

选项	小计	比例
是	57	96.61%
否	2	3.39%
本题有效填写人次	59	

饼状 圆环 柱状 条形 折线

第6题：你喜欢的授课方式是什么？ [多选题]

选项	小计	比例
以实战模拟为主	45	76.27%
以案例分析为主	54	91.53%
以主题研讨为主 [详细]	2	3.39%
其他 [详细]	1	1.69%
本题有效填写人次	59	

饼状 圆环 柱状 条形 折线

第7题：你是否会在课堂中积极提出你遇到的疑难问题？ [单选题]

选项	小计	比例
我会大胆积极的在讲解的过程中提		

第7题：你是否会在课堂中积极提出你遇到的疑难问题？ [单选题]

选项	小计	比例
我会大胆积极的在讲解的过程中提问	13	22.03%
我会等导师讲解完私下问	14	23.73%
我有点害怕不敢问	23	38.98%
我不需要提问，他讲完我就会了	5	8.47%
不感兴趣，不知该问什么	4	6.78%
本题有效填写人次	59	

饼状 圆环 柱状 条形 折线

第8题：你希望企业导师的授课持续下去吗？ [单选题]

选项	小计	比例
特别希望	54	91.53%
可有可无	4	6.78%
不想参与	1	1.69%
本题有效填写人次	59	

饼状 圆环 柱状 条形 折线

第9题：你希望企业导师讲授哪方面的内容？ [单选题]

选项	小计	比例
AI量化策略	28	48.28%
股指期货交易	7	12.07%
金融衍生品定价	2	3.45%
风险评估	2	3.45%
价值投资	10	17.24%
量化交易系统设计	8	13.79%
其他 [详细]	1	1.72%
本题有效填写人次	58	

饼状 圆环 柱状 条形 折线

第10题：你认为企业导师的授课对你哪方面会有提升？ [多选题]

选项	小计	比例
深化对理论知识的理解	46	79.31%
增强自己的财商和理财能力	48	82.76%
拓展视界，知识面更广	51	87.93%
提高量化投资实战能力	26	44.83%
其他 [详细]	0	0%





## 下一步工作举措：



- 配备随堂教师：杨洋博士，杨博士毕业于台湾大学，在证券公司工作6年
- 课前准备导师简介，根据导师的教学PPT或内容，随堂教师配合企业导师给出预习参考书目，布置课前作业
- 课中给出带照片的座次表，便于提问和实习
- 课后布置作业，随堂教师选出优秀作品给企业导师审阅。
- 增加仪式感：课前再次介绍导师介绍，课间组织师生午餐会，课后学生代表表达感悟，合影，赠送小礼物或安排周边考察
- 扩大范围：其他本科生，硕士，博士都来参与，人数过多的话限额报名，学院审批