证券投资学本科课程教学大纲

编制人：周斌

审定人：赖斌慧

开课部门：财务管理教研室

编制时间：2019.7.16

一、课程基本信息

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 课程名称 | 中文 | 证券投资学 | | |
| 英文 | Security Analysis and Investment | | |
| 课程代码 | 18419050200 | | 课程性质 | 专业选修课程 |
| 课程学分 | 2 | | 课程学时 | 32 |
| 适用专业 | 财务管理 | | 课程组负责人 | 周斌 |
| 课程组成员 | 周斌 | | | |
| 先修课程 | 会计学、微观经济学、宏观经济学、金融学等 | | | |
| 选用教材 | 吴晓求. 证券投资学（第4版）.北京：国人民大学出版社，2015. | | | |
| 参考书目 | 1. 滋维•博迪，投资学(第9版). 北京：机械工业出版社，2016。  2. 曹凤岐，刘力，姚长辉. 证券投资学. 北京：北京大学出版社，2016 | | | |
| 推荐教材 | 吴晓求. 证券投资学（第4版）.北京：国人民大学出版社，2015. | | | |

二、课程目标

**（一）课程具体目标**

|  |  |
| --- | --- |
| **序 号** | **课程具体目标** |
| 课程目标1 | 掌握证券投资的含义，对证券投资有个大概的了解。通过学习，从整体上理解和把握整门课程的内容框架，为以后各章的学习奠定良好的基础。。 |
| 课程目标2 | 了解投资主体的含义；熟悉个人投资者的投资目的和资金来源；了解机构投资者含义和特征；熟悉政府及政府机构、企业法人、金融机构的投资目的和范围；熟悉证券投资者与证券投机者的定义、区别；了解证券投机的作用。 |
| 课程目标3 | 掌握证券交易所的定义、特征、组织形式；熟悉证券上市制度；掌握证券交易所的运行系统；掌握证券交易所的交易原则和交易规则；了解证券行情表的阅读；熟悉证券交易所的功能。 |
| 课程目标4 | 了解证券分析信息的内容和来源；熟悉宏观经济分析对证券投资的意义和分析的内容；掌握行业一般特征的分析、经济周期与行业分析、行业生命周期分析,了解影响行业兴衰的主要因素；熟悉公司竞争地位分析、盈利能力分析、公司经营管理能力分析的主要指标。 |
| 课程目标5 | 了解现代证券投资理论的产生和发展。熟悉证券组合的分散原理；掌握证券组合预期收益率的计算；掌握证券组合风险的测算；掌握可行组合、有效组合的概念；掌握最优证券组合的条件和选择。 |

**（二）课程目标与毕业要求的关系**

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **课程目标** | **支撑的毕业要求** | **支撑的毕业要求指标点** |
| 课程目标1 | 毕业要求1: 知识要求 | 1.2掌握财务管理专业必备的理论、知识和方法。 |
| 毕业要求4: 素质要求 | 4.2具有法治意识和社会责任感，在经济管理实践中理解并自觉遵守职业规范，能够认真履行职责。 |
| 课程目标2 | 毕业要求2: 知识要求 | 1.1掌握经济、管理、法律等基础知识。  1.2掌握财务管理专业必备的理论、知识和方法。 |
| 毕业要求3: 能力要求 | 3.2具有将专业知识融会贯通，综合运用专业知识分析和解决问题的能力。 |
| 课程目标3 | 毕业要求2: 能力要求 | 3.2具有将专业知识融会贯通，综合运用专业知识分析和解决问题的能力。  3.3具有利用创造性思维开展科学研究和创新创业的能力。 |
| 课程目标4 | 毕业要求2: 技能要求 | 2.2能够使用统计软件、数理计算工具等现代通用经济管理分析技术与工具，分析解决经济管理问题，并理解其局限性。  2.3具备合理的信息技术知识和技能，能够使用专业分析方法与工具分析解决复杂财务管理问题。 |
| 毕业要求3: 能力要求 | 3.4具有自主学习的能力、终身学习的意识，有适应环境变化不断接受新知识、新理论、新技术的能力。 |
| 课程目标5 | 毕业要求2：技能要求 | 2.3具备合理的信息技术知识和技能，能够使用专业分析方法与工具分析解决复杂财务管理问题。 |
| 毕业要求4: 素质要求 | 4.2具有法治意识和社会责任感，在经济管理实践中理解并自觉遵守职业规范，能够认真履行职责。 |

三、课程教学要求与重难点

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **序号** | **课程内容框架** | **教学要求** | **教学重点** | **教学难点** |
| 1 | 第1章　证券投资工具 | 掌握证券投资的含义，对证券投资有个大概的了解。通过学习，从整体上理解和把握整门课程的内容框架，为以后各章的学习奠定良好的基础。 | 证券投资的定义。 | 证券投资学在发展中存在的问题。 |
| 2 | 第2章　证券市场 | 了解投资主体的含义；熟悉个人投资者的投资目的和资金来源；了解机构投资者含义和特征；熟悉政府及政府机构、企业法人、金融机构的投资目的和范围；熟悉证券投资者与证券投机者的定义、区别；了解证券投机的作用。 | 普通股票、优先股、后配股、混合股的含义。 | 证券投资收益风险。 |
| 3 | 第3章　证券投资基本分析 | 要求学生了解证券分析信息的内容和来源，熟悉宏观经济分析对证券投资的意义和分析的内容；了解行业一般特征的分析，熟悉行业选择的方法；熟悉公司竞争地位分析、盈利能力分析等。 | 证券投资基本分析的内容。 | 财务分析。 |
| 4 | 第4章　证券投资技术分析 | 要求学生熟悉技术分析的主要理论和方法。 | 技术分析的主要理论。 | 技术分析的实际分析技巧。 |
| 5 | 第5章　证券投资量化分析 | 要求学生熟悉量化投资的基本概念、信息比率的定义、信息比率与其他比率的比较，了解α的预测与前瞻信息比率。 | 量化投资的基本概念、信息比率的定义、信息比率与其他比率的比较。 | α的预测与前瞻信息比率。 |
| 6 | 第6章　证券组合管理 | 熟悉证券组合的分散原理；掌握证券组合预期收益率的计算，掌握可行组合、有效组合的概念，掌握最优证券组合的条件和选择；了解马柯维茨学说的基本观点及其贡献。 | 市场证券组合。 | 马科维茨选择资产组合方法。 |
| 7 | 第7章　风险资产的定价与证券组合管理的应用 | 理解证券投资的功能；  学会证券投资风险和收益的测量方法；  掌握证券投资的方式策略。 | 证券投资风险和收益的测量方法。 | 套利定价理论**。** |
| 8 | 第8章　投资组合管理业绩评价模型 | 熟悉投资组合管理业绩评价基本方法，掌握单因素投资业绩评价模型及多因素整体业绩评估模型。 | 投资组合管理业绩评价基本方法**。** | 多因素整体业绩评估模型。 |

四、课程教学内容、教学方式、学时分配及对课程目标的支撑情况

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **序号** | **课程内容框架** | **教学内容** | **教学方式** | **学时** | **支撑的**  **课程目标** |
| 1 | 第1章　证券投资工具 | 1.1 投资概述  　　1.2 债 券  　　1.3 股 票  　　1.4 证券投资基金  　　1.5 金融衍生工具  　　1.6 另类投资工具 | 讲授、案例分析 | 4学时 | 课程目标1  课程目标4  课程目标5 |
| 2 | 第2章　证券市场 | 2.1 证券市场概述  　　2.2 证券市场的运行机制  　　2.3 证券市场监管 | 讲授、案例分析 | 4学时 | 课程目标1  课程目标4  课程目标5 |
| 3 | 第3章　证券投资基本分析 | 3.1 证券投资的宏观经济分析  　　3.2 证券投资的产业分析  　　3.3 公司财务分析  　　3.4 公司价值分析 | 讲授、案例分析 | 8学时 | 课程目标1  课程目标2  课程目标3 |
| 4 | 第4章　证券投资技术分析 | 4.1 技术分析的概述  　　4.2 技术分析的主要理论和方法 | 讲授、上机实验 | 6学时 | 课程目标1  课程目标3 |
| 5 | 第5章　证券投资量化分析 | 5.1 量化投资的基本概念  　　5.2 信息比率的定义  　　5.3 信息比率的应用  　　5.4 信息比率与其他比率的比较  　　5.5 α的预测与前瞻信息比率 | 讲授 | 2学时 | 课程目标1  课程目标3 |
| 6 | 第6章　证券组合管理 | 6.1 证券组合管理概述  　　6.2 马科维茨选择资产组合方法 | 讲授 | 2学时 | 课程目标1  课程目标3  课程目标5 |
| 7 | 第7章　风险资产的定价与证券组合管理的应用 | 7.1 资本资产定价模型  　　7.2 套利定价理论  　　7.3 期权定价理论 | 讲授 | 2学时 | 课程目标1  课程目标4  课程目标5 |
| 8 | 第8章　投资组合管理业绩评价模型 | 8.1 投资组合管理业绩评价概述  　　8.2 单因素投资业绩评价模型  　　8.3 多因素整体业绩评估模型  　　8.5 进一步的研究 | 讲授 | 4学时 | 课程目标1  课程目标4 |

五、课程目标与考核内容

|  |  |
| --- | --- |
| **课程目标** | **考核内容** |
| 课程目标1 | 证券投资基本含义及相关概念整体性知识的掌握情况 |
| 课程目标2 | 证券投资相关对象的基本内容及它们之间的关系，投资与投机的区别等知识的掌握情况 |
| 课程目标3 | 证券投资基本业务内容及具体实践操作能力的熟悉程度 |
| 课程目标4 | 对资本市场中各类证券投资的发展动态、监管政策法规等的了解程度 |
| 课程目标5 | 解决证券投资业务中的实际问题能力 |

六、考核方式与评价细则

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **考核方式** | **比例** | **考核/评价细则** |
| 课堂表现 | 20% | 考勤记录和课堂表现情况加分、扣分记录。 |
| 上机实验 | 20% | 证券投资上机实训项目完成情况汇总记录表。 |
| 期末考试 | 60% | 笔试，题型有选择题、判断题、简答题、计算题和论述题，考核内容涵盖了所学的基本知识点，不仅考核学生对基本知识点的掌握程度，而且也考察对相关知识和理论运用的能力。 |