投资学本科课程教学大纲

编制人：何圣财

审定人：乔红芳

开课部门：金融与统计系

编制时间：2019年6月30日

一、课程基本信息

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 课程名称 | 中文 | 期货与期权 |
| 英文 | Futures and Option |
| 课程代码 |  | 课程性质 | 专业选修课程 |
| 课程学分 | 3 | 课程学时 | 48（其中：16上机） |
| 适用专业 | 经济与金融 | 课程组负责人 |  |
| 课程组成员 |  |
| 先修课程 |  证券投资学、金融学、投资学 |
| 选用教材 | 李一智等. 期货与期权教程（第6版）. 北京：清华大学出版社，2017 |
| 参考书目 | 1. (美)约翰·赫尔. 期货与期权市场导论（第七版）.北京：中国人民大学出版社，20142. 邓小朱. 期货与期权：理论、实务、案例. 北京：中国人民大学出版社，20173. 罗孝玲. 期货与期权（第三版）. 北京：高等教育出版社，20164. 许可，李强. 期货与期权基础教程. 北京：高等教育出版社，20165. 张效梅. 期货与期权. 北京：经济科学出版社，2017 |
| 推荐教材 | 李一智等. 期货与期权教程（第6版）. 北京：清华大学出版社，2017 |

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 | 掌握期货的概念与内涵，商品期货的组织与管理，商品期货交易的制度、法规、交易的基本策略、价格的分析与预测，金融期货的涵义及其交易；掌握期权交易的相关知识。 |
| 课程目标2 | 运用期货与期权相关理论和方法分析实践问题 |
| 课程目标3 | 树立正确的期货与期权投资理念、遵纪守法，践行社会主义核心价值观 |
| 课程目标4 | 了解一些期货与期权的前沿理论及实践 |

**（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 专业知识。牢固掌握本专业基础知识、基本理论与基本技能。既要掌握经济学、管理学的基本原理，也要充分了解金融理论前沿和实践发展现状，熟悉金融活动的基本流程。 |
| 毕业要求2:素质要求 | 2.2 专业素质。具有金融专业思维和较强的学科意识。熟悉国家有关金融的方针、政策和法律法规，了解国内外金融发展动态。 |
| 毕业要求3:能力要求 | 3.1 获取知识的能力。能够掌握有效的学习方法，主动接受终身教育。能够应用现代科技手段进行自主学习。适应金融理论和实践快速发展的客观情况，与时俱进。 |
| 课程目标2 | 毕业要求1: 知识要求 | 1.2 专业知识。牢固掌握本专业基础知识、基本理论与基本技能。既要掌握经济学、管理学的基本原理，也要充分了解金融理论前沿和实践发展现状，熟悉金融活动的基本流程。 |
| 毕业要求3:能力要求 | 3.2 实践应用能力。能够在金融实践活动中灵活运用所掌握的专业知识。能够对各种国内外的金融信息加以甄别、整理和加工，从而为政府、企业、金融机构等部门解决实际问题提供对策建议。能够运用专业理论知识和现代经济学研究方法，具备一定的科学研究能力。 |
| 课程目标3 | 毕业要求2:素质要求 | 2.1 思想道德素质。努力学习马克思列宁主义、毛泽东思想和中国特色社会主义理论体系，确立在中国共产党领导下走中国特色社会主义道路、实现国家繁荣昌盛的共同理想和坚定信念。遵守宪法、法律和法规，遵守公民道德规范。 |
| 课程目标4 | 毕业要求2:素质要求 | 2.2 专业素质。具有金融专业思维和较强的学科意识。熟悉国家有关金融的方针、政策和法律法规，了解国内外金融发展动态。 |
| 毕业要求3:能力要求 | 3.3 创新创业能力。既要有创新意识，也要有创新能力和创业能力。能够把握金融发展的趋势，学以致用，创造性地解决实际金融问题。具有专业敏感性，在激烈的市场竞争和国际竞争中敢于创新，善于创新。 |

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章期货交易导论 | 掌握期货的含义、分类、上市条件，期货交易的性质与功能；熟悉商品期货交易运作的基本流程；理解期货市场与现货市场的关系；了解期货交易的发展历史。 | 期货的概念、种类、上市条件；期货交易的性质与功能；期货市场与现货市场的关系；商品期货交易的运作。 | 期货市场的功能、与现货市场的关系；商品期货的运作流程。 |
| 2 | 第2章商品期货市场的管理 | 掌握商品期货交易所的含义及其组织形式、性质；熟悉商品期货交易所的相关制度法规；熟悉期货公司及其运作；了解商品期货市场的行政管理、行业管理。 | 商品期货交易所的组织与性质；商品期货交易所的制度和法规；期货公司相关知识。 | 商品期货交易所的组织；期货公司的相关知识。 |
| 3 | 第3章商品期货交易所的制度和法规 | 掌握套期保值的含义及交易策略；掌握基差交易、叫价交易规则；理解动态套期保值中最佳套保比率的确定方法；熟悉商品期货交易的基本策略；了解套期图利交易。 | 套期保值交易、基差交易、叫价交易、投机交易；期货交易的基本策略；最佳套保比率的确定。 | 套期保值交易等各类交易的原理与策略；最佳套保比率的确定。 |
| 4 | 第4章 商品期货价格分析和预测 | 掌握期货交易的基本分析法；熟悉使用期货交易的各类技术分析方法。 | 期货价格分析和预测的两种方法：基本分析法和技术分析法。 | 各类方法的合理使用 |
| 5 | 第5章 金融工具期货交易 | 掌握外汇期货、利率期货以及股指期货的含义；熟悉各类金融期货的特点；了解中国金融期货交易所及所交易的金融期货品种。 | 外汇期货、利率期货以及股指期货的含义与特点。 | 各类金融期货的特征 |
| 6 | 第6章 期权交易 | 掌握期权的含义、特征、交易规则、交易策略；了解期权的定价；了解新型期权。 | 期权及期权交易相关知识 | 期权的定价 |
| 7 | 第7章 商品期货市场的风险控制 | 掌握期货市场风险的概念、识别；理解期货市场风险的评估方法、预警指标体系；了解期货市场风险控制措施。 | 期货市场风险及其辨识；风险评估与风险预警体系。 | 期货市场风险辨识；风险预警指标体系。 |

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章期货交易导论 | 1. 期货交易的历史概况2. 商品期货交易的形成与基本概念 | 讲授 | 1学时 | 课程目标1 |
| 3. 期货交易的性质和功能 | 讲授 | 1学时 | 课程目标1 |
| 4. 期货市场同现货市场的关系5. 期货商品种类与上市条件 | 讲授、案例分析 | 1学时 | 课程目标1 |
| 6. 商品期货交易的运作 | 讲授、案例分析 | 1学时 | 课程目标1课程目标2 |
| 2 | 第2章商品期货市场的管理 | 1. 商品期货市场的政府行政管理2. 商品期货市场的行业管理 | 讲授 | 1学时 | 课程目标3课程目标4 |
| 3. 商品期货交易所的组织与性质4. 商品期货交易所的制度和法规 | 讲授 | 1学时 | 课程目标1课程目标4 |
| 5. 期货公司 | 讲授、案例分析 | 1学时 | 课程目标1课程目标3 |
| 3 | 第3章商品期货交易所的制度和法规 | 1. 套期保值交易 | 讲授、案例分析 | 2学时 | 课程目标1课程目标2 |
| 2. 基差交易、叫价交易与“场外”交易3. 动态套期保值中最佳套保比率的确定 | 讲授 | 1学时 | 课程目标1课程目标2 |
| 4. 投机与套期图例交易 | 讲授、案例分析 | 1学时 | 课程目标1 |
| 5. 商品期货交易基本策略 | 讲授、案例分析 | 1学时 | 课程目标1课程目标2 |
| 4 | 第4章 商品期货价格分析和预测 | 1. 基本分析法 | 讲授、案例分析 | 1学时 | 课程目标1课程目标2 |
| 2. 技术分析法的图形方法 | 讲授、案例分析 | 2学时 | 课程目标1课程目标2 |
| 3. 技术分析法的指标方法 | 讲授、案例分析 | 2学时 | 课程目标1课程目标2 |
| 5 | 第5章 金融工具期货交易 | 1. 外汇期货 | 讲授 | 1学时 | 课程目标1 |
| 2. 利率期货 | 讲授 | 2学时 | 课程目标1 |
| 3. 股票价格指数期货概论 | 讲授 | 2学时 | 课程目标1 |
| 4. 中国金融期货交易所及其股指期货 | 讲授、案例分析 | 1学时 | 课程目标1课程目标4 |
| 6 | 第6章 期权交易 | 1. 期权交易概述  | 讲授 | 1学时 | 课程目标1 |
| 2. 期权的定价 | 讲授 | 2学时 | 课程目标1 |
| 3. 期权交易策略 | 讲授、案例分析 | 2学时 | 课程目标1课程目标2 |
| 4. 新型期权 | 讲授 | 1学时 | 课程目标1课程目标4 |
| 7 | 第7章 商品期货市场的风险控制 | 1. 期货市场风险的概念2. 期货市场的风险辨识 | 讲授 | 1学时 | 课程目标1 |
| 3. 期货市场风险评估 | 讲授 | 1学时 | 课程目标1 |
| 4. 期货市场风险预警指标体系5. 期货市场风险控制 | 讲授、案例分析 | 1学时 | 课程目标1 |

五、课程目标与考核内容

|  |  |
| --- | --- |
| **课程目标** | **考核内容** |
| 课程目标1 | 有关期货、期权理论知识的理解和掌握情况 |
| 课程目标2 | 利用期货、期权理论解决处理投资问题的能力 |
| 课程目标3 | 期货与期权投资理念是否正确？对国家相关政策的理解程度 |
| 课程目标4 | 有关期货与期权前沿问题及相关实践的了解情况 |

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 | 15% | 考勤记录和课堂表现情况加分、扣分记录 |
| 作业 | 15% | 期货与期权所布置的课后作业完成情况 |
| 期末考试 | 70% | 闭卷考试，题型有选择题、简答题、计算题等多种题型，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。 |