

# 《证券投资学》课程教学大纲

## 一、课程简介

课程中文名	证券投资学				
课程英文名	Investment			双语授课	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否
课程代码	05112231	课程学分	3	总学时数	48
课程类别	<input type="checkbox"/> 通识教育课程 <input type="checkbox"/> 公共基础课程 <input checked="" type="checkbox"/> 专业教育课程 <input type="checkbox"/> 综合实践课程 <input type="checkbox"/> 教师教育课程	课程性质	<input checked="" type="checkbox"/> 必修 <input type="checkbox"/> 选修 <input type="checkbox"/> 其他	课程形态	<input type="checkbox"/> 线上 <input checked="" type="checkbox"/> 线下 <input type="checkbox"/> 线上线下混合式 <input type="checkbox"/> 社会实践 <input type="checkbox"/> 虚拟仿真实验教学
考核方式	<input checked="" type="checkbox"/> 闭卷 <input type="checkbox"/> 开卷 <input type="checkbox"/> 课程论文 <input type="checkbox"/> 课程作品 <input checked="" type="checkbox"/> 汇报展示 <input type="checkbox"/> 报告 <input checked="" type="checkbox"/> 课堂表现 <input type="checkbox"/> 阶段性测试 <input checked="" type="checkbox"/> 平时作业 <input type="checkbox"/> 其他（可多选）				
开课学院	财经学院		开课系(教研室)	金融系	
面向专业	金融工程、财务管理、国际经济与贸易、经济统计学		开课学期	第5学期	
课程负责人	刘开华		审核人	余函	
先修课程	微观经济学、宏观经济学				
后续课程	智能投顾实训				
选用教材	戴亨钊.证券投资学[M].中国商业出版社, 2023.				
参考书目	1. [美]兹维.博迪, 投资学 [M]. 机械工业出版社, 2023 2. 吴晓求. 证券投资学[M]. 中国人民大学出版社, 2023.				
课程资源	1. <a href="#">【中央财经大学】证券投资学（全28讲）何晓宇</a> 2. <a href="#">【清华大学】《投资学》证券投资必修课, 炒股必看!（全44课）</a>				
课程简介	<p>《证券投资学》是一门专业核心课程，主要讲述股票、债券、基金、衍生工具以及证券市场的基本理论和运行规律，证券投资基本分析、技术分析、证券投资策略与技巧等内容。通过教学使学生掌握证券投资的基本理论和知识体系，能够从宏观、中观、微观三个层面分析证券价格波动的原因，透彻理解宏观经济变量对市场趋势的影响，准确把握行业周期变化所带来的投资机会，能够根据上市公司的经营状况选择合适的投资对象，培养学生证券投资创新决策能力，独立思考批判能力和投资理财能力。</p>				

## 二、课程目标

表 1 课程目标

序号	具体课程目标
课程目标 1	思想道德与身心素质。能够在马克思主义指导下运用投资学的基本知识、基本理论、基本范畴及其运动规律。能够以社会主义核心价值观为指导，使学生具备扎实的专业素养和良好的职业道德。
课程目标 2	专业知识与专业能力。能够运用证券投资工具进行投资，能够从宏观、中观、微观三个层面分析证券价格波动的原因，能够分析宏观经济变量对市场趋势的影响，能够把握行业周期变化所带来的投资机会，能够根据上市公司的经营状况选择合适的
课程目标 3	职业素养与创新实践。坚决贯彻执行党和国家有关金融经济方针政策，能够运用常用的投资分析方法，把握金融发展的趋势，学以致用，具备发现问题与解决问题的能力，能够创造性地解决金融问题。能够分析上市公司投资价值、财务状况、上市公司的技术、管理及行业地位分析，能够分析上市公司经营情况与行业前景调查分析，具备从事各类投资活动的决策和管理能力。
课程目标 4	发展能力与职业成就。具备终身学习能力，在团队项目任务中能够主动学习和分析国内外金融发展动态、金融政策，能够进入银行、证券公司、保险公司、投资公司、投资咨询公司、资产管理公司、基金管理公司及信托公司等金融机构从事投资管理、投资咨询工作，能够胜任各类企事业单位、政府部门以及教学科研单位的投资管理岗位工作，能够树立正确的投资理念，养成良好的投资习惯。

表2-1 课程目标与毕业要求对应关系（适用于专业教育课程）

毕业要求	指标点	课程目标
毕业要求3: 专业知识【M】	3.2具备扎实的经济学、金融学、金融工程专业理论基础。	课程目标1
毕业要求4: 专业能力【H】	4.3能运用所学的经济学、金融学、金融工程知识对经济环境进行分析、预测，并将其应用于业务决策。	课程目标2
毕业要求6: 团队合作【H】	6.1能够与他人进行有效的业务沟通和工作协调，较好地适应团队工作。	课程目标4
毕业要求7: 创新创业【M】	7.1具备创新精神、创业意识和创新创业能力。	课程目标3
毕业要求3: 终身学习【L】	8.1具有专业发展意识，主动了解国内外金融发展动态，能够适应时代和金融发展需求。	课程目标4

### 三、课程学习内容与方法

#### (一) 理论学习内容及要求

表3-1 课程目标、学习内容和教学方法对应关系

序号	课程模块	学习内容	学习任务	课程目标	学习重点难点	教学方法	学时
1	证券投资概述	1.证券投资的概念及特点	<b>拓展劳动实践：搜集整理实时财经新闻</b>	课程目标1	重点： 1.证券投资的特点 2.投资与投机	<b>讲授法：</b> 引导学生掌握证券投资的基本概念	4
		4.证券投资与投机		课程目标2			
2	证券投资工具	1.股票的概念、特点及其分类，股票价格的计算	<b>1.个人作业：股票价格的计算，债券价格的计算，期货、期权的盈亏计算</b> <b>2.拓展劳动实践：查阅资料钻研股指期货投资</b>	课程目标3	重点： 1.股票价格的计算；债券价格的计算 难点： 2.远期、期货、期权、互换的概念，期货、期权的盈亏计算	<b>情景模拟：</b> 通过模拟炒股促进学生掌握证券投资工具的概念及特点	16
		2.债券的概念、特点、分类，债券价格的计算		课程目标3			
		3. 证券投资基金的概念、特点、分类		课程目标3			
		4.金融衍生工具的概念、特点，远期、期货、期权、互换的概念		课程目标3			
3	证券投资市场	1.证券发行市场	<b>1.拓展阅读：证券IPO的流程</b> <b>2.线上劳动实践：通过模拟炒股掌握证券交易的规则</b>	课程目标2	重点： 1.证券IPO发行的条件 2.证券交易的规则	<b>专题讨论：</b> 通过案例分析引导学生掌握证券IPO的条件，掌握证券交易的规则	6
		2.证券交易市场		课程目标2			
4	证券投资理论	1.证券投资组合收益和风险	<b>1.拓展阅读：投资组合理论</b> <b>2.线上劳动实践：查阅资料钻研行为金融理论</b>	课程目标3	重点： 1.投资组合理论 2.行为金融理论	<b>专题讨论：</b> 引导学生掌握投资组合理论和行为金融理论	10
		2.投资组合理论		课程目标4			
		3.资本资产定价模型		课程目标4			
		4.套利定价理论		课程目标4			

		5.有效市场理论		课程目标4			
		6.行为金融理论		课程目标4			
5	证券投资分析、策略与监管	1.基本分析	1.拓展阅读：巴菲特的 投资方法 2.小组劳动实践：股价 操纵与内幕交易案例分 析	课程目标4	重点： 1.基本分析 2.技术分析	专题讨论：引导学生掌 握证券基本分析和技术 分析的方法	12
		2.技术分析		课程目标4			
		3.证券投资策略分析		课程目标3			
		4.证券投资监管		课程目标1			

## 四、课程考核

(一) 考核内容与考核方式 (考核内容含实验要反映主要的课程目标; 考核方式要适合课程性质, 如: 课堂表现、平时作业、阶段性测试、调研报告、课程大论文、闭卷考试、开卷考试等。)

表4-1 课程目标、考核内容与考核方式对应关系

课程目标	考核内容	所属学习模块/项目	考核占比	考核方式
课程目标 1	1. 证券投资的概念及特点	1. 证券投资概述	10%	闭卷考试 (选择题10分)
	2. 证券投资监管	5. 证券投资分析、策略与监管		
课程目标 2	1. 证券投资与投机	1. 证券投资概述	20%	闭卷考试 (问答题20分)
	2. 证券发行市场	3. 证券投资市场		
	3. 证券交易市场	3. 证券投资市场		
课程目标 3	1. 股票的概念、特点及其分类, 股票价格的计算	2. 证券投资工具	40%	闭卷考试 (计算题20分、 选择题20分)
	2. 债券的概念、特点、分类, 债券价格的计算	2. 证券投资工具		
	3. 证券投资基金的概念、特点、分类	2. 证券投资工具		
	4. 金融衍生工具的概念、特点, 远期、期货、期权、互换的概念, 期货、期权的盈亏计算	2. 证券投资工具		
	3. 证券投资策略分析	5. 证券投资分析、策略与监管		
课程目标 4	1. 投资组合理论	4. 证券投资理论	30%	闭卷考试 (分析题20分、 作图题10分)
	2. 资本资产定价模型	4. 证券投资理论		
	3. 套利定价理论	4. 证券投资理论		
	4. 有效市场理论	4. 证券投资理论		
	5. 行为金融理论	4. 证券投资理论		
	6. 基本分析	5. 证券投资分析、策略与监管		
	7. 技术分析	5. 证券投资分析、策略与监管		

评分依据: 如果课程论文或作品设计是课程考核的唯一方式, 必须明确课程论文或作品设计的内容与课程目标的达成度, 写明评分依据。

表4-2 课程目标与考核方式矩阵关系

课程目标	考核方式 (成绩比例)				考核占比 (此处需与上表基本一致)
	期末考试	课堂表现	平时作业	汇报展示	

	60%	10%	10%	20%	
课程目标1	10%	10%	10%	10%	$10\%=60\%*10\%+10\%*10\%+10\%*10\%+20\%*10\%$
课程目标2	20%	20%	20%	20%	$20\%=60\%*20\%+10\%*20\%+10\%*20\%+20\%*20\%$
课程目标3	40%	40%	40%	40%	$40\%=60\%*40\%+10\%*40\%+10\%*40\%+20\%*40\%$
课程目标3	30%	30%	30%	30%	$30\%=60\%*30\%+10\%*30\%+10\%*30\%+20\%*30\%$

## （二）成绩评定

**1.平时成绩评定**（有合理的、多维度的过程性考核方式；考核内容覆盖课程目标、考核结果能合理反映课程目标的达成度；考核权重与教学内容相匹配；各考核环节必须有明确的考核标准）。

**（1）课堂表现（10%）：**通过学生在课堂上的表现情况、发言与提问情况，来评价学生相关的能力。

**（2）作业完成情况（10%）：**围绕课程的学习目标进行作业的设计，让学生简述对知识的认识，考核学生对于概念的理解情况，帮助学生将定义转化为自己的理解。

**（3）汇报展示（20%）：**针对老师给定的选题范围，学生3-4人分小组讨论，合作完成PPT汇报展示。

### 2.期末成绩评定

期末考核主要考查学生对证券投资基本概念、操作程序和具体方法的理解与运用等。方式为闭卷考试。要求学生掌握基本概念、操作程序，运用具体方法解决相关问题。

### 3.总成绩评定

总成绩由平时考核成绩和期末考核成绩构成，其构成比例为：

总成绩（100%）=平时成绩（40%）+期末成绩（60%）

## （三）评分标准

针对课程考核方式中的所有项目，均需制定相应的评分标准，明确具体评分细则。其中试卷考核项目以试卷参考答案及评分细则为准，非试卷考核项目可参照以下示例制定。

表5 评分标准（试卷考核项目）

考核项目	评分标准
1.选择题	每小题2分，共30分，多选、错选、漏选均不给分。

2.计算题	每小题5分，共20分，要求写出详细的解题步骤
3.问答题	每小题5分，共20分，要求对各答案要点分别进行阐述，言之有理均可得分
4.作图题	每小题5分，共10分，按要求画出图形，并进行简单分析
5.分析题	每小题10分，共20分，理论结合实际，言之有理均可得分

## 五、其它说明

本课程大纲依据2023版金融工程专业人才培养方案，由财经学院金融系讨论制定，财经学院教学工作委员会审定，教务处审核批准，自2023级开始执行。