

《投资学》课程教学大纲

课程名称： 投资学			课程类别（必修/选修）： 专业必修课		
课程英文名称： Investments					
总学时/周学时/学分： 32/2/2			其中实验学时： 8		
先修课程： 微观经济学、宏观经济学、货币银行学、公司金融、会计学					
授课时间： 1-16 周四 3-4 节			授课地点： 莞城 6211		
授课对象： 2018 国贸 1-4 班					
开课学院： 经济与管理学院					
任课教师姓名/职称： 邱宜干 教授					
答疑时间、地点与方式： 课间休息答疑、电子邮件答疑、微信答疑、课堂答疑。					
课程考核方式： 开卷（ ） 闭卷（ ） 课程论文（ <input checked="" type="checkbox"/> ） 其它（ ）					
使用教材：《投资学（第 10 版）》，（美）博迪等著，汪昌云等译，机械工业出版社 2019 年 1 月。 教学参考资料：《货币金融学（第九版）》，弗雷德里克·S·米什金，中国人民大学出版社 2011 年。					
课程简介： 投资学是国贸专业的一门重要的专业选修课， 投资学讲述的主要内容有绪论、资产组合理论与实践、资本市场均衡、固定收益证券等内容。					
课程教学目标 一、知识目标 1. 掌握投资学的基本概念、基础知识和基本工具。 2. 掌握投资学的基本原理和学科方法。 二、能力目标 1. 运用专业知识的能力：初步具备运用投资学的原理和方法分析解决现实中投资的基本问题和分析具体案例的能力。 2. 发展能力：初步具备债券和股票投资的操作能力， 并能适应社会的需求不断提升和进步。 三、素质目标 1.培养学生主动参与、积极进取、认真思考、探索未知的学习态度和思想意识； 2. 养成理论联系实际、科学严谨、认真细致、实事求是的学习态度和爱岗敬业的职业道德。			本课程与学生核心能力培养之间的关联(授课对象为理工科专业学生的课程填写此栏)：		
理论教学进程表					
周次	教学主题	教学	教学的重点与难点、课程思政融入点	教学方式	教学 作业安排

		时长		(线上/线下)	手段	
1	投资环境	1	重点: 实物资产、金融资产的区分 课程思政融入点: 介绍公司金融理论的发展过程, 了解马科维茨、米勒、莫迪利安尼、夏普、法玛、布莱克、斯科尔斯等经济学家的贡献, 让学生潜移默化受到影响, 从而树立为国奋斗的远大理想。	线上: 优学院+微信	讲授	课程思政作业: 要求学生每人至少阅读两篇与金融理论有关的文章。
2	资产类别与金融工具	2	重点: 债券市场、股票市场 难点: 衍生工具市场	线上: 优学院+微信	讲授	
3	证券如何交易	1	重点: 证券交易的全过程 难点: 证券市场的监管	线上: 优学院+微信	讲授	
4	共同基金与其他投资公司	2	重点: 投资公司、共同基金的区分 难点: 共同基金投资成本的计算	线上: 优学院+微信	讲授	
5	风险与收益	1	重点: 投资收益的计算 难点: 投资风险的衡量	线上: 优学院+微信 / 线下	讲授	
6	风险资产配置	2	重点: 效用最大风险资产最优头寸 难点: 资本市场线的本质	线上: 优学院+微信 / 线下	讲授	
7	最优风险资产组合	2	重点: 两个风险资产的组合 难点: 最优风险组合的计算	线上: 优学院+微信 / 线下	讲授	
8	指数模型	1	重点和难点: 单指数模型	线上: 优学院+微信 / 线下	讲授	
9	资本资产定价模型	1	重点: 有效资产组合 难点: 证券市场线	线上: 优学院+微信 / 线下	讲授	
10	套利定价理论	2	重点和难点: 套利定价理论 课程思政融入点: 介绍“一鸟在手”理论, 强调“宁要手中一只鸟, 不要林中一群鸟”。用该理论指导学生进行股票操作, 短线炒股做到见好就收。股价涨不要贪, 股价跌不悲观。生活正如炒股, 要有好的心态。	线上: 优学院+微信 / 线下	讲授	课程思政作业: 要求学生阅读一鸟在手理论的典型案例。
11	有效市场假说	2	重点: 有效市场假说的含义 难点: 市场有效的研判	线上: 优学院+微信 / 线下	讲授	
12	行为金融与技术分析	2	重点: 行为金融理论与传统金融理论的异同 难点: 如何应对投资者的非理性行为	线上: 优学院+微信 / 线下	讲授	
13	宏观与行业分析	2	重点: 外围经济条件如何影响投资者?	线上: 优学	讲授	课程思政作

			课程思政融入点： 通过外围经济条件的分析，让学生明白影响投资的因素有很多，投资是一个系统工程，要有全局观和多因素观。懂得多角度发散思维，真正做到三思而后行！	院+微信/线下		业：要求学生阅读《彼得·林奇的成功投资》。
14	权益估值与公司财务报表分析	1	重点：股票的估值模型、财务报表的分析方法 难点：股利贴现模型的运用	线上：优学院+微信/线下	讲授	
15	债券的价格与收益	1	重点：债券的价格和收益率的计算	线上：优学院+微信/线下	讲授	
16	期末复习	1	课程思政融入点： 通过对 Excel 几种财务函数的讲解，然后再让部分同学进行实际操作，希望同学们懂得“纸上得来终觉浅，绝知此事要躬行”的真正含义！	线上：优学院+微信/线下	讲授	课程思政作业：要求学生上网阅读陆游的《冬夜读书示子聿》一诗。
合计：		24				

实践教学进程表

周次	实验项目名称	学时	重点与难点	项目类型（验证/综合/设计）	教学方式	作业安排
1	实物资产、金融资产的判别	1	实物资产的判别 金融资产的判别	教材第 20 页：习题 7	分组讨论	P20：8
3	卖空的计算	1	Excel 的应用和操作	教材第 64 页：卖空实例	课堂讲解	P70：6、7
5	月指数收益的计算	1	Excel 的应用和操作	P108：例 5-10 正态分布函数	分组讨论	P126：7、8
8	最优风险组合的构造程序	1	Excel 的应用和操作	P204：实例	课堂讲解	P211：17
9	CAPM 的应用	1	股票 α 值的计算	P222：概念检查 9-4	分组讨论	P235：10-16
14	股利贴现模型的应用	1	固定增长模型的把握	P450：概念检查 18-2	分组讨论	P471：14
15	债券价格的计算	1	Excel 的应用和操作	P343：债券定价	课堂讲解	P362：14、21
16	债券收益率的计算	1	债券到期收益率的计算	P344：例 14-4	分组讨论	P351：概念检查 14-7
合计：		8				

成绩评定方法及标准

考核形式	评价标准	权重
课后作业	根据布置的课外作业完成情况给分，包括五次各章课后作业和四次思政融入点作业。	10%

课前任务	根据老师布置的课前任务进行预习，并积极反馈。	5%
课堂训练	根据课堂讨论与练习的表现情况给分：非常好，95-100 分；比较好，85-95；一般，70-85 分；合格，60-70 分；很差，60 分以下。	15%
三次测试	开课测试、中期测试、结课测试均按百分制打分。	10%
期末考试	按要求完成一篇 3000 字的课程论文。	60%
大纲编写时间：2020 年 4 月 4 日		
<p>系（部）审查意见：</p> <p>同意</p> <p>系（部）主任签名：陈海东</p> <p>2020 年 4 月 6 日</p>		