

# 《证券投资理论与实务》课程教学大纲

## 一、课程与任课教师基本信息

课程名称：证券投资理论与实务	课程类别：专业课限选课
课程英文名称：The securities investment theory and practice	
总学时/周学时/学分：54/3/3	其中实验（实训、上机等）学时：18
先修课程：高等数学（微积分）、微观经济学、宏观经济学、会计学基础、财务管理	
授课时间：2016-2017 学年第 2 学期	授课地点：莞城 3209
授课对象：2014 国际经济贸易 1-2 班	
开课院（系）：经济与管理学院	
任课（/助课）教师姓名/职称：陈海东/讲师	编写人姓名/职称：陈海东/讲师
使用教材：吴晓求《证券投资学（第四版）》精编版 出版社：中国人民大学出版社 出版时间：2014 年	
教学参考资料： (美)罗伯特·雷亚 译者：刘志刚 《道氏理论》，出版社：地震出版社，2013 年； 汪昌云等编著 《投资学》（第二版）（经济管理类课程教材 金融系列）中国人民大学出版社，2013 年； Zvi Bodie, Alex Kane, Alan J. Marcus 《投资学》（第 9 版）出版社：机械工业出版社出版，2012 年； Victor Sperandeo 《专业投机原理》出版社：机械工业出版社出版，2010 年	
课程期末考核方式：开卷（ ） 闭卷（ ） 课程论文（√） 实操（√）	
联系电话：13925771222(7122)	Email: 1139257711@qq.com
答疑时间、地点与方式：课间休息答疑、通过电子邮件、QQ、微信答疑、特约答疑、期中、期末统一答疑。	
编写时间：2017 年 2 月 18 日星期六	

## 二、课程简介

《证券投资理论和实务》是引领人们进入金融学术殿堂的概论性课程。通过学习本课程使学生掌握关于证券投资的基础知识、有价证券价格决定及证券组合基础理论；掌握证券投资的基本分析理论和方法，了解证券投资技术分析的基本原理和市场投资心理因素；正确理解证券市场的基本功能，了解证券监管的基本理论。

## 三、课程目标

证券投资学研究的核心标的是有价证券价格的决定，有价证券价格的影响因素众多，如宏观政策消息、产业信息、具体公司消息、以及市场投资者心理情绪因素等。由于这些消息和因素经常变化和更新，造成市场中有价证券的价格也在不断地发生变化。因此，本课程的主要目标是结合实际证券市场中证券价格的变化来讲解证券投资分析的基本逻辑、方法和技术，并引导学生运用所学知识分析中国证券市场中的投资机会。具体目标如下：

**1.知识与技能目标：**掌握有价证券估值的基本原理和现代资产组合理论基本

内容；理解证券投资分析的基本逻辑和分析框架；了解证券投资技术分析的基本技术指标和公司财务指标、以及资本市场运行的一般规律；能够运用所学知识分析中国证券市场中的行业及公司投资机会。

**2.过程与方法目标：**通过观察实时证券市场（主要是中国股票市场）中的证券价格变化，并结合各种相关消息和市场心理因素，运用所学的基本原理和逻辑分析证券价格变化的影响因素，锻炼学生的投资分析能力和投资机会发掘能力。

**3.情感、态度与价值观发展目标：**通过分析影响证券价格长期趋势的宏观、行业和公司基本面因素，培养学生长期投资的理念；结合实际市场中投资心理的分析，克服或减少日常投资中错误心理的影响，为学生以后的投资行为树立正确的观念。

#### 四、课程进度表

理论教学进程表

周次	教学主题	教学时长	教学的重点与难点		教学方式	作业安排
1、3、4	课程介绍及导论、证券投资工具	9	理解证券投资(概念、特点；能得到什么？如何做好？)	了解证券投资的历史、投资工具类型。	讲授	课堂作业、课堂调查课后思考
5	证券投资工具证券市场、资产定价理论及其发展	3	证券市场的运行机制	资产定价模型	讲授讨论	
6	宏观与产业分析	3	货币和财政政策与证券价格之间的关系	理解宏观和产业因素如何影响证券价格	讲授讨论	习题作业
7	公司财务分析	3	掌握公司财务报表指标分析的基本方法	净资产回报率的杜邦分解	讲授	调研作业
8	公司价值分析	3	股利折现估值模型的推导 权益资产绝对估值模型 权益资产的相对估值模型	掌握股利折现估值模型，了解自由现金流折现估值模型	讲授	
9	技术分析主要理论与方法	3	技术分析的理论基础、一些技术指标	了解技术分析的主要理论流派	讲授讨论	课后操作作业
10-12	技术分析主要理论与方法	9	震荡中枢走势理论	了解走势类型结构	讲授讨论	课后操作作业
13	证券组合管理	2	资产组合理论的依据、资本资产定价模型的了解	理解资产组合理论的实际应用	讲授	
13	债券组合管理	1	债券定价理论	久期的理解	讲授	
合计		36				

实践教学进程表

周次	教学主题	教学时长	教学的重点与难点	教学方式	实验安排
2	对行情软件的初步认识	3	了解当前普通投资者经常使用的资讯、行情软件的使用方法，理解一些指标的使用	学生为主，教师指导、引导为辅	上机
14	对技术分析的操作	3	对走势图形的技术分解	学生为主，教师指导、引导为辅	上机
15-18	调研报告	12	运用整个前面章节的学习和前面的操作，对本学期各自跟踪的上市公司形成一个完整的分析报告；完成整个不少于 12 周的操作总结报告（总结个人的投资理念和方法）。	学生为主，教师指导、引导为辅	
合计		18			

#### 五、成绩评定方法及标准

考核内容	评价标准	权重
到堂情况	（满分 100 分）旷课 1 次扣 20 分， 迟到 1 次扣 10 分（百分制）	5%
完成作业	模拟炒股成绩+技术分析报告+操作总结	25%
期末考核	按照分析报告的完成情况（百分制）	70%
考试方式	分析报告	

#### 六、院（系）教学指导委员会审查意见

我院（系）教学指导委员会已对本课程教学大纲进行了审查，同意执行。

院（系）教学指导委员会主任签名：

日期： 年 月 日