

《投资学》课程教学大纲

课程名称：投资学	课程类别（必修/选修）：专业选修课
课程英文名称：Investments	
总学时/周学时/学分：36/2/2	其中实验/实践学时：0
先修课程：微观经济学、宏观经济学、金融学、会计学、财务管理、统计学、概率论与数理统计	
授课时间：1-18 周周二上午 1-2 节	授课地点：莞城 5205
授课对象：2017 国际经济与贸易 1、2 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（ ☐ ）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。 《投资学》，李学峰，科学出版社，2016 年第三版。	
课程简介：投资学是国际贸易专业的一门重要的专业选修课。本课程主要讲述投资的基本概念、基本原理和基本理论，重点讲述证券投资组合、资本资产定价模型、指数模型、套利定价模型、有效市场假说、行为金融、证券估值理论等现代金融理论。学生通过本课程的学习，了解证券投资的基本知识，基本方法和技巧，熟悉证券市场基本业务，为实务操作奠定理论基础。	
课程教学目标 1.了解证券投资的基本操作步骤，掌握证券市场 and 金融工具的基本概念和基本理论。 2.通过课堂理论知识讲授与课外投资实践，掌握投资的基本技能。 3.通过理论模型的学习，培养学生投资理念和综合运用理论知识能力。 4.了解国内外经济金融发展形势和证券投资的最新动向，树立密切关注投资前沿，不断与时俱进的意识。	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)： ☐ 核心能力 1. 具备自主的学习能力，良好的专业知识表达能力，协调沟通能力，基本的资料搜集、文献检索能力。 ☐ 核心能力 2. 具有良好的综合应用知识能力和实践能力。 ☐ 核心能力 3. 具有良好的创新思维能力、创新实践能力，具备一定的研究开发能力。 ☐ 核心能力 4. 具有良好的人际交流交往能力，能适应社会的需求不断进步。

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	翻转课堂法介绍	2	翻转课堂的流程、视频制作、课堂教学设计	讲授	开课作业
2	投资环境与金融工具、证券交易与金融公司	2	实物资产与金融资产区别、金融市场类型、投资过程、金融资产类型、市场指数、衍生产品、证券发行与交易过程、交易成本与市场监管	翻转课堂	反馈作业
3	风险与收益	2	利率决定因素、持有其收益率、风险与风险溢价、风险度量、风险投资组合	翻转课堂	反馈作业
4	风险资产配置	2	资产配置、无风险资产、资本市场线、单一资产投资组合	翻转课堂	反馈作业
5	最优风险资产组合	2	投资分散化、资产配置过程、马科维茨模型	翻转课堂	反馈作业
6	指数模型	2	单因素模型、单指数模型，指数模型应用	翻转课堂	反馈作业
7	资本资产定价模型	2	资本资产定价模型、资本资产定价模型与指数模型的关系	翻转课堂	反馈作业
8	资本资产定价模型	2	资本资产定价模型学习讨论	翻转课堂	反馈作业
9	套利定价模型	2	多因素模型、套利定价理论	翻转课堂	中期作业
10	风险收益多因素模型	2	多因素套利定价理论	翻转课堂	反馈作业
11	有效市场假说	2	随机漫步概念、有效市场假说	翻转课堂	反馈作业
12	行为金融与技术分析	2	行为学派观点、技术分析及与行为金融关系	翻转课堂	反馈作业
13	证券收益的实证依据	2	指数模型与单因素套利模型、多因素CAPM和APT的检验、法码-弗伦奇三因素模型	翻转课堂	反馈作业
14	资本市场均衡综合分析	2	资本资产定价模型、套利定价模型与风险收益多因素模型学习总结与讨论	翻转课堂	反馈作业
15	债券价格与收益	2	债券特点、债券定价与收益率、违约风险与债券定价关系	翻转课堂	反馈作业
16	利率的期限结构	2	收益曲线、远期利率、期限结构理论	翻转课堂	反馈作业
17	债券资产组合管理	2	利率风险、消极与积极债券管理	翻转课堂	反馈作业
18	期末复习	2	考试题型介绍、考试内容复习	讲授	结课作业
合 计:		36			

成绩评定方法及标准		
考核形式	评价标准	权重
到课情况	全勤满分，缺勤一次扣 20 分， 迟到或早退一次扣 10 分	10%
课堂讨论与练习	课堂表现非常积极 95-100 分， 比较积极 85-95， 表现一般 70-85 分， 基本合格 60-70 分， 表现很差 60 分以下	15%
课外学习与练习	根据布置的课外的学习任务 and 练习完成情况给分， 包括作业答题准确率， 完成率、美观及学习积极性。	15%
期末考核	开卷考试， 按考试标准答案给分。	60%
大纲编写时间：2019 年 3 月 3 日		
系（部）审查意见： 同 意 系（部）主任签名：  2019 年 3 月 11 日		