

《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 3-4 节			授课地点：莞城 6412		
授课对象：2017 国际经济与贸易 3、4 班					
开课学院：经济与管理学院					
任课教师姓名/职称：彭俊华 讲师					
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，掌握证券市场和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	投资环境与金融工具	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	讲授	P21:11\15\17\19 P44:5\16

2	证券交易与金融公司	2	证券发行与交易过程、交易成本与市场监管	讲授	P70:1\4\5\7 P88:4\6\
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	混合式	P126:3\7\13
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	混合式	P145:1\2\4\14\20
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	讲授	P173:1\2\3\9\11
6	指数模型	2	单因素模型、单指数模型，指数模型应用	混合式	P210:1\4\6\8
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	讲授	P235:1\4\8\17
8	资本资产定价模型	2	资本资产定价模型学习讨论	小组讨论	
9	套利定价模型	2	多因素模型、套利定价理论	讲授	
10	风险收益多因素模型	2	多因素套利定价理论	讲授	P254:1\5\6\8
11	有效市场假说	2	随机漫步概念、有效市场假说	讲授	P283:6\7\10\12\14
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	混合式	P304:2\5\17
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	讲授	P330:3-7
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	小组讨论	
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	讲授	P361:1\6\8\9
16	利率的期限结构	2	收益曲线、远期利率、期限结构理论	讲授	P380:2-6\10
17	债券资产组合管理	2	利率风险、消极与积极债券管理	讲授	P407:3\4\9
18	期末复习	2	考试题型介绍、考试内容复习	混合式	
合计:		36			
成绩评定方法及标准					
考核形式		评价标准			权重
到堂情况		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			15%

	分以下	
课外学习与练习	根据布置的课外的学习任务和练习完成情况给分，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：2019.3.2		
系（部）审查意见：		
同 意 系（部）主任签名： 日期：2019 年 3 月 11 日		