

《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： 54/3/3			其中实验学时： 4		
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： 1-18 周周二（双）1-2 节、周四 1-4 节； 1-18 周周二（单）1-2 节			授课地点： 莞城 6412		
授课对象： 2016 经济金融 3-4 班、2017 经济金融 2、3、4 班					
开课院系： 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。					
课程简介： 投资学是投资学专业和金融学专业的一门重要的基础理论课， 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 1. 掌握投资学的基本知识和原理； 2. 了解投资的环境和主要的金融工具； 3. 掌握风险与收益的关系； 4. 掌握资本资产定价模型和套利定价理论； 5. 了解市场有效假设的基本内容； 6. 掌握债券定价和收益率的计算方法； 7. 知道债券和股票投资的基本操作。			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. 有较强的逻辑思维、辩证思维和形象思维的能力，有理性的批判意识，尊重客观事物发展的、科学的、务实的思维方法； ☐ 核心能力 2. 崇尚科学、求真务实，具有较强的创新意识和创新创业精神； ☐ 核心能力 3. 掌握投资学的研究方法，尤其是实证分析和规范分析的基本方法； ☐ 核心能力 4. 了解投资学的最新进展情况，了解专业发展的前沿问题和热点问题； ☐ 核心能力 5. 具有较强的实践意识，能从实际出发理解投资学理论知识，具有一定的运用投资学基本知识和基本理论解决现实问题的能力； ☐ 核心能力 6. 具有国际化视野和跨文化交流合作的能力，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、金融工具	3	实物资产与金融资产、金融市场类型、投资过程、金融市场类型、股票\债券市场指数	讲授	作业
2	证券交易与共同基金	3	证券发行、证券交易过程、交易成本、证券监管、投资公司类型、共同基金与交易基金	讲授	
3	风险与收益	3	利率的决定因素、风险与收益溢价的内容	混合式	课堂作业
4	风险资产配置	3	无风险资产、单一资产的投资组合	混合式	
5	最优风险资产组合	3	资产配置过程、马科维茨投资组合模型	混合式	课堂作业
6	指数模型	3	单因素模型、单指数模型	混合式	
7	资本资产定价模型	3	资本资产定价模型与指数模型的关系及其拓展形式	混合式	课堂作业
8	套利定价理论	3	多因素模型、多因素套利定价理论	混合式	
9					
10	套利定价理论	3	多因素模型、多因素套利定价理论、多因素资本资产定价模型与套利定价理论的关系	混合式	课堂作业
11	有效市场假设	3	随机漫步的概念、有效市场假设的内容	混合式	
12	行为金融与技术分析	3	行为学派的观点、技术分析的概念	混合式	课堂作业
13	证券收益的实证依据	3	多因素 CAPM 和 APT 检验	混合式	
14	债券的价格与收益	3	债券的特点、债券的定价与收益率的计算、债券的违约风险与定价的关系	混合式	课堂作业
15	债券的价格与收益	3	债券的定价与收益率的计算、债券的违约风险与定价的关系	混合式	
16	利率的期限结构	3	收益曲线、利率期限结构理论	混合式	课堂作业
17	债券资产组合管理	3	利率风险、消极和积极的债券管理	混合式	
18	期末复习	2	考试题型介绍、考试内容复习	混合式	作业
合计:		50			

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
9	Excel 解决投资中的实际问题	4	学会如何正确使用金融函数		传统法	作业
合计:		4				

成绩评定方法及标准

考核形式	评价标准	权重
课后练习	根据布置的课外学习任务和练习完成情况给分，包括	15%

	作业答题准确率，完成率、美观及学习积极性。	
课前任务	根据老师布置的课前任务进行预习，并积极反馈	10%
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	10%
期中考试	做一份中期试卷。	5%
期末考试	按期末试卷评分标准执行。	60%

大纲编写时间：2019 年 2 月 25 日

系（部）审查意见：

同 意



系（部）主任签名：

日期： 2019 年 3 月 11 日