

中国社会科学院大学证券投资学课程大纲

课程基本信息 (Course Information)					
课程编号 (Course ID)	102132032114	学时 (Credit Hours)	48	学分 (Credits)	3
课程名称 (Course Name)	证券投资学 Securities Investment				
先修课程 (Prerequisite Courses)	无要求				
课程简介 (Description)	<p>本课程在马克思主义理论指导下,着重介绍证券投资的基本理论与基本知识,以及从事证券投资的方式与方法。是一门以证券投资理论与实践为研究对象的课程。该课程的主要任务是,使学生了解证券投资的基础理论,建立对证券投资学基本知识框架及主要规律的理论把握,研究证券投资过程中客观存在的各种经济现象和客观规律,并基于证券投资的目的,认识和总结证券投资中存在的各种复杂经济关系的实质,使学生掌握从事证券投资的主要方式与方法,包括运用较为广泛的各种分析方法、策略与技巧,为在证券投资中进行科学决策与操作提供知识准备,并学会面向证券投资实践进行分析与操作。</p> <p>证券投资学作为一门专业核心课,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、有价证券价格决定基础理论;掌握证券投资的基本分析的理论和方法,了解证券投资技术分析的基本原理;正确理解证券市场的基本功能,了解证券监管现的基本理论,了解我国证券市场发展状况。采取课堂教学教师主讲,实践教学学生主操并完成课堂作业。</p>				
课程简介 (Description)	<p>Under the guidance of Marxist theory, this course focuses on the basic theory and knowledge of securities investment, as well as the ways and methods of engaging in securities investment. It is a course with the theory and practice of securities investment as the research object. The main task of this course is to make students understand the basic theory of securities investment, establish a theoretical grasp of the basic knowledge framework and main laws of securities investment, study various</p>				

	<p>objective economic phenomena and laws in the process of securities investment, and understand and summarize the essence of various complex economic relations in securities investment based on the purpose of securities investment, so that students can master the main ways and methods of engaging in securities investment, including using a wide range of analytical methods, strategies and skills, and provide knowledge for scientific decision-making and operation in securities investment.</p> <p>As a specialized core course, securities investment is an introductory course that leads people into the financial academic hall. By studying this course, students can master the basic knowledge about securities investment and the basic theory of securities price determination; Master the theory and method of basic analysis of securities investment and understand the basic principle of technical analysis of securities investment; Correctly understand the basic functions of the securities market, the basic theory of securities supervision, and the development of China's securities market. Take the classroom teaching teacher as the main speaker, practice teaching students the main exercises and complete the classroom homework.</p>		
<p>教材 (Textbooks)</p>	<p>吴晓求. 证券投资学(第五版)[M]. 北京: 中国人民大学出版社, 2020年2月第5版。ISBN: 9787300278155。</p>		
<p>参考资料 (Other References)</p>	<p>曹凤岐、刘力、姚长辉. 证券投资学(第3版)[M]. 北京: 北京大学出版社, 2013年9月第3版。ISBN: 9787301229699。</p>		
<p>课程类别 (Course Category)</p>	<p><input type="checkbox"/>公共基础课/全校公共必修课 <input type="checkbox"/>通识教育课 <input type="checkbox"/>专业基础课 <input checked="" type="checkbox"/>专业核心课/专业必修课 <input type="checkbox"/>专业拓展课/专业选修课 <input type="checkbox"/>其他_____</p>		
<p>授课对象 (Target Students)</p>	<p>全校本科生</p>	<p>授课模式 (Mode of Instruction)</p>	<p><input type="checkbox"/>线上 <input type="checkbox"/>教学平台_____</p> <p><input checked="" type="checkbox"/>线下 <input type="checkbox"/>混合式 <input type="checkbox"/>融合式 <input type="checkbox"/>其他</p> <p><input type="checkbox"/>实践类(70%以上学时深入基层)</p>
<p>开课部门 (School)</p>	<p>应用经济学院</p>	<p>授课语言 (Language of Instruction)</p>	<p><input checked="" type="checkbox"/>中文 <input type="checkbox"/>全外语_____</p> <p><input type="checkbox"/>双语: 中文+_____ (外语讲授不低于50%)</p>

授课教师信息 (Teacher Information)	课程负责人 姓名及简介		何理，中国社会科学院大学应用经济学院讲师。清华大学博士、北京大学博士后。主要研究领域为数字经济及金融科技。在《经济研究》《经济学动态》《金融研究》等 CSSCI 学术期刊上发表了二十多篇论文，出版了数部著作，主持了国家社会科学基金项目等数项课题。此外，曾担任发改委、自然资源部等国家部委及国家开发银行、上海证券交易所、腾讯公司等企业的咨询专家。				
	团队成员 姓名及简介		无				
学习目标 (Learning Outcomes)	<ol style="list-style-type: none"> 1. 了解我国证券市场发展状况，理解证券市场的基本功能； 2. 掌握关于证券投资的基础知识； 3. 掌握证券投资的基本分析的理论和方法，了解技术分析的基本原理； 4. 提高理论分析与实践结合的能力，提高分析问题与解释问题的能力。 						
考核方式 (Grading)	<ol style="list-style-type: none"> 1. 平时成绩 30%，期末成绩 70%。 2. 平时成绩包括考勤、课堂表现。 3. 期末成绩根据期末论文质量。 						
课程教学计划 (Teaching Plan) 填写规范化要求见附件							
周次	周学时	其中					教学内容摘要 (必含章节名称、讲述的内容提要、实验的名称、教学方法、课堂讨论的题目、阅读文献参考书目及作业等)
		讲授	实验课	习题课	课程讨论	其他环节	
第一周	3	1	2	0	0	0	第一章 证券投资工具 第一节 投资概述 第二节 债券

							<p>第三节 股票</p> <p>第四节 证券投资基金</p> <p>第五节 金融衍生工具</p> <p>第六节 另类投资工具</p>
第二周	3	1	2	0	0	0	<p>第二章 证券投资工具</p> <p>第一节 证券市场概述</p> <p>第二节 证券市场的运行机制</p> <p>第三节 证券市场监管</p>
第三周	3	1	2	0	0	0	<p>第三章 资产定价理论及其发展</p> <p>第一节 20 世纪 50 年代以前的资产定价理论</p> <p>第二节 20 世纪 50 年代至 80 年代的资产定价理论</p> <p>第三节 20 世纪 80 年代以后兴起的行为金融资产定价理论</p>
第四周	3	1	2	0	0	0	<p>第四章 证券投资的宏观经济分析</p> <p>第一节 宏观经济分析概述</p> <p>第二节 宏观经济运行对证券市场的影响</p> <p>第三节 宏观经济政策与证券市场</p> <p>第四节 经济周期、经济政策对大类资产及证券市场的综合影响</p>
第五周	3	1	2	0	0	0	<p>第五章 证券投资的产业分析</p> <p>第一节 产业分析概述</p> <p>第二节 产业的基本特性分析</p> <p>第三节 产业环境分析</p>

							<p>第四节 产业生命周期分析</p> <p>第五节 产业结构分析</p>
第六周	3	1	2	0	0	0	<p>第六章 公司财务分析</p> <p>第一节 如何阅读上市公司的财务报表</p> <p>第二节 基于资产负债表的资产管理分析</p> <p>第三节 基于利润表的经营效益分析</p> <p>第四节 基于现金流量表的现金流分析</p>
第七周	3	1	2	0	0	0	<p>第七章 公司价值分析</p> <p>第一节 公司基本分析</p> <p>第二节 绝对估值法</p> <p>第三节 相对估值法</p>
第八周	3	1	2	0	0	0	<p>第八章 证券投资技术分析概述</p> <p>第一节 技术分析的理论基础</p> <p>第二节 市场行为的四个要素：价、量、时、空</p> <p>第三节 技术分析方法的分类和局限性</p> <p>第四节 与技术分析有关的几个理论</p> <p>第五节 价量配合的案例分析</p>
第九周	3	1	2	0	0	0	<p>第九章 技术分析的主要理论和方法</p> <p>第一节 道氏理论</p> <p>第二节 K 线理论</p> <p>第三节 支撑压力</p> <p>第四节 形态理论</p> <p>第五节 波浪理论</p>

							第六节 技术指标
第十周	3	1	2	0	0	0	第十章 证券组合管理 第一节 证券组合管理概述 第二节 马科维茨选择资产组合的方法
第十一周	3	1	2	0	0	0	第十一章 风险资产的定价与证券组合管理的应用 第一节 资本资产定价模型 第二节 套利定价理论 第三节 期权定价理论
第十二周	3	1	2	0	0	0	第十二章 投资组合管理业绩评价模型 第一节 投资组合管理业绩评价概述 第二节 单因素投资基金业绩评价模型 第三节 多因素整体业绩评估模型 第四节 时机选择与证券选择能力评估模型 第五节 进一步的研究
第十三周	3	1	2	0	0	0	第十三章 债券组合管理 第一节 债券定价理论 第二节 可转换债券定价理论
第十四周	3	1	2	0	0	0	第十四章 量化投资、大数据分析 with 智能投顾 第一节 量化投资的基本概念 第二节 信息比率

							第三节 α 的预测与前瞻信息比率 第四节 大数据在投资中的应用 第五节 智能投顾
第十五周	3	1	2	0	0	0	第十五章 简单量化交易策略 第一节 多因子量化投资策略 第二节 动量与反转策略 第三节 MACD
第十六周	3	1	2	0	0	0	总结与答疑
总计	48	16	32	0	0	0	无
备注 (Notes)				无			