**《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 |
| **课程英文名称：**Macroeconomics |
| **总学时/周学时/学分：**54/3/3 | **其中实验/实践学时：**18 |
| **先修课程：**会计学、经济学 |
| **授课时间：**周一1-3节（2班） | **授课地点：**6312与实验楼616（2班） |
| **授课对象：**2017级经济与金融系2班 |
| **开课学院：**粤台产业科技学院 |
| **任课教师姓名/职称：**谢依珊/副教授 |
| **答疑时间、地点与方式：**周二15：00-16：30/实验楼204办公室/面授与讨论 |
| **课程考核方式：**开卷**（）**闭卷**（√）**课程论文**（）**其它**（）** |
| **使用教材：**《投资学教程》，刘晓燕，上海财经大学出版社，第二版，2016年5月第2次印刷。**教学参考资料：**《投资学》，刘红忠、高等教育出版社，2015年2月出版。 |
| **课程简介：**课程从投资人的角度出发，介绍各种投资工具的基本知识与相关制度。教学内容包括了了解各种投资工具的类别、风险与预期报酬率外；影响各个投资工具价值的因素，例如总体经济、产业、个别公司经营情况等；最后形成投资组合，适当地将资金分配到各种价格被市场低估的投资工具上；而最终能够建构出一个稳健的投资策略。 |
| **课程教学目标**1. 理解金融商品的发行、市场交易实务、報酬與風險的衡量方式、以及风险控制的方法。
2. 运用数据库，撷取、分析上市公司或是基金的相关信息，从中选取被市场低估的标的物。
3. 综合投资理论的相关模型，建构一个稳健的交易策略，评价该策略是否有投资价值，并作为学期论文的主要内容。
 | **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.** 财务规划与营销专业能力（Profession）■**核心能力2.** 诚正品德之素养（Righteousness）**□核心能力3.**跨专业创新与团队合作能力（EQ Emotional Intelligence）■**核心能力4.**市场实操与风险管理能力（Management）■**核心能力5.**大数据分析与人工智能编程能力（Information）■**核心能力6.** 互联网加与信息运用能力（Utility）**□核心能力7．**财金外文与国际移动能力（Mobility） |
| **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 | 证券投资与证券市场 | 3 | 重点：证券市场的主体、类型、层次与监管。难点：了解中国资本市场的发展现况。 | 讲授、讨论与课堂练习 |  |
| 2 | 有效市场假说 | 3 | 重点：区别弱式有效、半强式有效、强式有效的假说`；行为金融学。难点：行为金融学的理解。 | 讲授、讨论与课堂练习 |  |
| 3 | 最佳投资组合的选择 | 3 | 重点：资产组合的含义与度量、有效集及无差异曲线。难点：如何有效集及无差异曲线选择最佳投资组合。 | 讲授、讨论与课堂练习 |  |
| 4 | 资本资产定价模型 | 3 | 重点：经典资本资产定价模型、特征线模型、资本资产定价模型的应用与检验难点：阿尔法系数的含义是什么？在证券投资中阿尔法系数有何作用。 | 讲授、讨论与课堂练习 |  |
| 5 | 因素模型与套利定价理论 | 3 | 重点：三因素模型与套利定价理论难点：APT与CAPM之差异。 | 讲授、讨论与课堂练习 |  |
| 6 | 期货 |  | 重点：远期与期货、期货交易机制、期货套期保值与套利交易。难点：投资者如何使用基差的概念来进行期货投资。 | 讲授、讨论与课堂练习 |  |
| 7 | 期权 | 3 | 重点：期权市场的运作、期权的特征与交易策略。难点：实务上期权的交易。 | 讲授、讨论与课堂练习 |  |
| 8 | Python | 3 | 重点：Python简介。难点：安装Python并熟悉基本语法。 | 讲授、讨论与课堂练习 |  |
| 9 | Python:最佳投资组合选择的实际应用 | 3 | 重点：以实际的股价资料寻找最佳投资组合。难点：股票的选择。 | 讲授、讨论与课堂练习 |  |
| 10 | 期中考 | 3 | 闭卷考试 |  |  |
| 11 | Python:资本资产定价模型的实际应用 | 3 | 重点：以实际的股价资料进行股票定价。难点：CAPM实际上的应用概念。 | 讲授、讨论与课堂练习 |  |
| 12 | 数据库资料撷取与分析1 | 3 | 重点：IMF数据库资料的介绍、宏观与金融数据的撷取与整理。难点：如何引起同学学习数据库的兴趣，并了解每项数据的意义。 | 讲授、讨论与课堂练习 |  |
| 13 | 数据库资料撷取与分析2 | 3 | 重点：预测经济周期的指标。难点：选择合适的数据进行分析。 | 讲授、讨论与课堂练习 |  |
| 14 | 数据库资料撷取与分析3 | 3 | 重点：利用撷取的数据绘图。难点：如何利用EXCEL或其他统计软体绘图。 | 讲授、讨论与课堂练习 |  |
| 15 | 数据库资料撷取与分析4 |  | 重点：认识Eviews软体、基本操作、汇入数据。难点：了解介面操作。 | 讲授、讨论与课堂练习 |  |
| 16 | 数据库资料撷取与分析5 | 3 | 重点：利用Eviews进行统计估计。难点：统计方法的应用，以及如何使用统计软体进行统计估计。 | 讲授、讨论与课堂练习 |  |
| 17 | 数据库资料撷取与分析6 | 3 | 重点：利用绘制的图与统计估计结果进行预测分析。难点：解读图形趋势与估计结果、判断估计结果优劣。 | 讲授、讨论与课堂练习 |  |
| 18 | 数据库资料撷取与分析7 | 3 | 重点：总结结果难点：分析最终结果。 | 讲授、讨论与课堂练习 |  |
| **合计：** | 54 |  |  |  |
| **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** |
| 12 | 数据库资料撷取与分析1 | 3 | 重点：IMF数据库资料的介绍、宏观与金融数据的撷取与整理。难点：如何引起同学学习数据库的兴趣，并了解每项数据的意义。 | 综合 | 讲授、讨论与课堂练习 |
| 13 | 数据库资料撷取与分析2 | 3 | 重点：预测经济周期的指标。难点：选择合适的数据进行分析。 | 综合 | 讲授、讨论与课堂练习 |
| 14 | 数据库资料撷取与分析3 | 3 | 重点：利用撷取的数据绘图。难点：如何利用EXCEL或其他统计软体绘图。 | 综合 | 讲授、讨论与课堂练习 |
| 15 | 数据库资料撷取与分析4 |  | 重点：认识Eviews软体、基本操作、汇入数据。难点：了解介面操作。 | 综合 | 讲授、讨论与课堂练习 |
| 16 | 数据库资料撷取与分析5 | 3 | 重点：利用Eviews进行统计估计。难点：统计方法的应用，以及如何使用统计软体进行统计估计。 | 综合 | 讲授、讨论与课堂练习 |
| 17 | 数据库资料撷取与分析6 | 3 | 重点：利用绘制的图与统计估计结果进行预测分析。难点：解读图形趋势与估计结果、判断估计结果优劣。 | 综合 | 讲授、讨论与课堂练习 |
|  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |
| **成绩评定方法及标准** |
| **考核形式** | **评价标准** | **权重** |
| 平时成绩 | 不迟到、不早退、不旷课、不滑手机、不饮食；课前准备充分，课堂积极发言、课堂习题演练、上机演练。 | 0.3 |
| 期中考试 | 根据评分标准评定分数（百分制） | 0.3 |
| 期末考试 | 根据评分标准评定分数（百分制） | 0.2 |
| 期末书面报告 | 根据评分标准评定分数（百分制） | 0.2 |
|  |  |  |
| **大纲编写时间：**2019-03-11 |
| **系（部）审查意见：** **符合人才培养计划目标，同意实行** 系（部）主任签名：谢松霖 日期：2019年3月18日 |