

《证券投资分析》课程教学大纲（2021 版）

课程基本信息 (Course Information)					
课程代码 (Course Code)	FI453	*学时 (Credit Hours)	32	*学分 (Credits)	2
*课程名称 (Course Name)	(中文) 证券投资分析				
	(英文) Securities Analysis				
课程性质 (Course Type)	限选 Distributional Electives				
授课对象 (Target Audience)	经管类本科生 Undergraduate Student in Economics and Management				
授课语言 (Language of Instruction)	全中文 Chinese				
*开课院系 (School)	安泰经济与管理学院 Antai College of Economics and Management				
先修课程 (Prerequisite)	经济学原理、商务统计学、金融学原理、货币金融学 Principles of Economics, Business Statistics, Principles of Finance, Money and Finance	后续课程 (post)			
*课程负责人 (Instructor)	卓建伟; 万相伟; 王宇曦; 陶亚民; 蔡明超 Zhuo Jianwei; Wan Xiangwei; Wang Yuxi; Tao Yamin, Cai Minchao	课程网址 (Course Webpage)			
*课程简介 (中文) (Description)	本课程为面向经济与管理类本科生的金融学专业核心课。本课程全面介绍证券投资分析的基础概念和相关理论知识, 主要包括投资环境、收益与风险、投资组合理论、资本市场均衡、证券分析以及应用投资组合管理等部分, 同步介绍证券投资领域最新发展情况, 使学生在掌握与投资相关的基本理论的同时, 了解其最新的市场发展动向。本课程将培养学生掌握证券投资分析的基本知识和原理, 要求学生从多个方面掌握证券投资分析的相关知识, 为将来更加深入的学习以及参与证券投资分析行业实践打好基础。				

<div>*课程简介（英文） (Description)</div>	This course is an introductory course on security analysis for undergraduates in economics and management. It is a core course for students majoring in finance. This course not only comprehensively introduces the relevant theoretical knowledge of security analysis, including investment environment, risk and return, portfolio theory, capital market equilibrium, securities analysis, and applied portfolio management, but also introduces the latest developments in the field of securities investment, so that students can understand the latest trends of security analysis while mastering the basic theories of security analysis. This course aims to help students to master the basic knowledge and principles of security analysis, require students to master relevant knowledge of security analysis in many aspects, and lay a solid foundation for more in-depth study and participation in the practice of securities analysis industry in the future.						
课程目标与内容（Course objectives and contents）							
<div>*课程目标 (Course Object)</div>	<div>1.了解并认识中国证券市场，深刻理解中国特色资本市场发展的意义。（A3，A2）</div> <div>Understand and know the Chinese securities market and deeply understand the significance of the Chinese capital markets. (A3, A2)</div> <div>2.熟悉主要金融产品及其交易机制，世界主要证券交易市场（B2，B5）</div> <div>Familiar with major financial products and their trading mechanisms, and the world's major securities exchanges (B2, B5.)</div> <div>3.掌握证券投资组合理论及其应用。（B1，B2，B4）</div> <div>Master the portfolio theory and its application. (B1, B2, B4)</div> <div>4. 掌握全球视野下的基本面分析方法和技术面分析方法。（C3，C5）</div> <div>Master the methods of fundamental analysis and technical analysis in a global perspective. (C3, C5)</div> <div>5. 掌握证券投资的绩效分析（D3）</div>						
<div>*教学内容进度安排及对应课程目标 (Class Schedule & Requirements & Course Objectives)</div>	章节	教学内容（要点）	学时	教学形式	作业及考核要求	课程思政融入点	对应课程目标
	示例：						
	第一章 Chapter 1	证券投资分析绪论 The Introduction of Investment	2	课堂教学、课堂讨论 Class Lecture and Discussion		通过学习证券投资分析的基本元素培养学生树立明辨是非的投资观念	课程目标1，2
	第二章	系统性风险与投资时机 Systemic	2	课 堂 教 学 Class Lecture	讨论题 Discussion	通过学习系统性风险培养学	课 程 目 标1，2

	Chapter 2	Risk and Investment Timing			n Problems	生风险、居安思危意识	
	第三章 Chapter 3	风险与收益 Risk and Return	4	课 堂 教 学 Class Lecture	作业 1 Classwork 1	通过学习风险与收益培养学生辩证的思维能力、踏实肯干的作风	课程目标 3
	第四章 Chapter 4	资产大类配置 Asset Allocation	2	课 堂 教 学 Class Lecture	小 组 课 堂 讨 论 Group Discussion in Class	通过学习大类资产配置培养学生辩证的思维能力、踏实肯干的作风	课程目标 3
	第五章 Chapter 5	最优风险组合 Portfolio Selection	4	课 堂 教 学 Class Lecture	EXCEL 求解 Solving via Excel	通过学习最优风险组合培养学生务实求真、追求真理的工作态度	课程目标 3
	第六章 Chapter 6	单指数模型 Single Index Model	4	课 堂 教 学 Class Lecture	EXCEL 求解 Solving via Excel	通过学习指数模型培养学生务实求真、追求真理的工作态度	课程目标 3
	第七章 Chapter 7	资产定价 CAPM	2	课 堂 教 学 Class Lecture	作业 2 Classwork 2	通过资产定价理论培养学生务实求真、追求真理的工作态度	课程目标 3
	第八章 Chapter 8	投资业绩评估 Performance Evaluation	2	课 堂 教 学 Class Lecture		通过学习投资绩效评估培养学生辩证思维、明辨是非的投资观念	课程目标 5
	第九章 Chapter 9	宏观经济与行业分析 Macroeconomic and Industry Analysis	4	课 堂 教 学 Class Lecture		通过学习基本分析培养学生辩证思维、理论联系实际的工作作风	课程目标 4

	第十章 Chapter 10	估值分析 Valuation Analysis	4	课堂教学 Class Lecture	作业 3 Classwork 3	通过学习估值分析培养学生勇于尝试、开放创新的工作作风	课程目标 4
	第十一章 Chapter 11	行为金融与技术分析 Behavioral Finance and Technical Analysis	2	课堂教学 Class Lecture		通过学习技术分析和行为金融培养学生勇于尝试、开放创新的工作作风	课程目标 4
注 1：建议按照教学周学时编排。 注 2：相应章节的课程思政融入点根据实际情况填写。							
*考核方式 (Grading)		(1) 考勤 10% Participation 10% 学生按时上课，不迟到早退，请假需提前申请。遵守课堂纪律，不做与课程学习无关事务，积极发言、参与相关讨论。 Students are required to attend classes on time and remain until the class is finished. Application for leave must be made in advance. Comply with classroom discipline, do not do anything unrelated to the course, actively speak, participate in relevant discussions. (2) 作业与讨论 30% Homework and Discussion 30% (3) 大作业或笔试 60% Course Project or Examination 60%					
*教材或参考资料 (Textbooks & Other Materials)		[1]《投资学》，博迪等，机械工业出版社，2019 年，第 1 版（原书第 10 版），ISBN: 9787111568230 Investments, Bodie, Kane, and Marcus, McGraw-Hill, 2014, 10th Edition. [2]《证券投资分析》，杨朝军等编，上海人民出版社，2018 年，第 4 版，ISBN: 9787543228900 Security Analysis (In Chinese), Yang Chaojun et al, Shanghai People's Publishing House, 2018, 4 th Edition					
其它 (More)							
备注 (Notes)							

备注说明：

1. 带*内容为必填项。
2. 课程简介字数为 300-500 字；课程大纲以表述清楚教学安排为宜，字数不限。