

《证券投资理论与实务》课程教学大纲

一、课程基本信息

课程名称	证券投资理论与实务				
	Securities Investments Theory and Practice				
课程代码	0010120	课程学分		2	
课程学时	32	理论学时	16	实践学时	16
开课学院	职业技术学院	适用专业与年级		工商企业管理 二年级	
课程类别与性质	专业选修课	考核方式		考查	
选用教材	《证券投资理论与实务》费玄淑、ISBN 9787565429064、东北财经大学出版社、第二版		是否为马工程教材	否	
先修课程	货币银行学 0060585 (3)				
课程简介	<p>一、目的</p> <p>证券投资理论与实务课程旨在培养学生在证券投资领域的理论和实践能力。该课程将介绍证券市场的基本知识和相关理论，并深入探讨证券投资的实际操作和策略。</p> <p>二、内容</p> <p>本课程学习的主要内容：（1）证券市场概述：介绍证券市场的基本概念、参与主体和市场结构；（2）投资组合理论：介绍投资组合理论和资产配置的原理。讲解风险与收益的权衡关系，以及如何通过不同资产类别的组合构建投资组合，实现风险分散和收益最大化；（3）技术分析 with 基本面分析；（4）证券投资策略；（5）风险管理与投资决策：讲解风险管理的基本概念和方法，包括风险评估、风险控制和资产配置。教授学生如何制定合理的投资目标和策略，并通过风险管理工具和技巧来规避和控制风险。</p> <p>三、预期成果</p> <p>学完本课程时，学生将获得对证券市场和证券投资的全面了解，掌握证券投资的基本理论和实践技能。他们将能够分析和评估证券投资机会，制定有效的投资策略，并在实际操作中进行风险管理和绩效评估。</p>				
选课建议与学习要求	本课程面向商贸类专业，二年级开设。要求具备一定的金融市场知识。				
大纲编写人	翁建伟		制/修订时间	2024.01	
专业负责人	高		审定时间	2024.01	
学院负责人			批准时间	2024.01	

二、课程目标

类型	序号	内容
知识目标	1	学习并理解证券投资基本理论。
技能目标	2	学会投资证券，买卖股票，实现投资盈利。
素养目标 (含课程思政目标)	3	通过学习证券投资活动中的伦理和法律问题，包括内幕交易、操纵市场、信息披露等道德和法律规范，明白遵守相关法律法规和道德准则的重要性。股海泛舟悟人生。

三、实验内容与要求

(一) 各实验项目的基本信息

序号	实验项目名称	实验类型	学时分配		
			理论	实践	小计
1	证券市场	④	4	4	8
2	证券交易	④	3	3	6
3	证券投资基本面分析	④	3	3	6
4	证券投资技术分析	④	4	4	8
5	证券投资操作策略	④	2	2	4

实验类型：①演示型 ②验证型 ③设计型 ④复合型

(二) 各实验项目教学目标与教学内容以及要求

实验 1：证券市场
<p>目标：了解证券市场的基本概念、参与主体和市场结构，熟悉不同类型的交易所和交易方式，以及常见的证券品种和交易规则。</p>
<p>内容：</p> <p>1 证券市场的基本概念：介绍证券市场的定义、特点和功能。</p> <p>2 参与主体：介绍证券市场的主要参与主体，包括投资者、发行人、交易所、证券公司等。讲解各个参与主体的职责和作用。</p> <p>3 市场结构：介绍证券市场的市场结构，包括一级市场和二级市场。讲解股票、债券、基</p>

金、衍生品等证券品种的特点和交易方式。

4 交易所：介绍不同类型的交易所，包括股票交易所、债券交易所、商品期货交易所等。讲解交易所的组织结构、功能和作用。

5 场外交易：介绍场外交易的定义、特点和交易方式。

6 证券品种和交易规则：介绍常见的证券品种和交易规则，包括股票、债券、基金、期货等证券品种的特点和交易规则。

要求：熟悉证券市场的参与主体和各个参与主体的职责和作用；理解证券市场的市场结构，包括一级市场和二级市场；熟悉不同类型的交易所的组织结构、功能和作用；

熟悉场外交易的定义、特点和交易方式；了解常见的证券品种和交易规则，包括股票、债券、基金、期货等证券品种的特点和交易规则。

实验 2：证券交易

目标：掌握证券交易的基本流程和操作技巧，了解交易执行的注意事项，以及评估投资绩效的方法。

内容：

1 证券交易流程：介绍证券交易的基本流程，包括开户、下单、成交、结算等环节。

2 市场报价和撮合：讲解市场报价的概念和意义，介绍买盘和卖盘的含义，以及交易所如何通过撮合机制实现交易配对。

3 交易执行方式：介绍证券交易的不同执行方式，包括现货交易、融资交易、融券交易等。

4 交易成本和费用：讲解交易成本的构成和计算方法，包括佣金、印花税、过户费等，帮助学生了解交易过程中可能产生的费用。

5 交易策略的执行：介绍常见的交易策略，如日内交易、趋势跟踪、价值投资等，以及如何在实际交易中执行这些策略。

6 投资绩效评估：讲解投资绩效评估的指标和方法，包括收益率、风险调整收益率、基准指数比较等，帮助学生评估自己的投资绩效并进行比较分析。

要求：能够计算交易过程中产生的费用；能够评估自己的投资绩效并进行比较分析；具备交易执行的技巧，包括下单时的注意事项、成交时的确认和核对、结算时的及时处理等。

实验 3：证券投资基本面分析

目标：掌握基本面分析的理论和方法，了解如何评估公司的价值和盈利能力，以及基于基本面分析做出投资决策的技巧。

内容：

1 基本面分析概述：介绍基本面分析的定义、意义和应用领域，帮助学生了解为什么基本面分析对于证券投资很重要。

2 公司财务报表分析：讲解财务报表的基本结构和内容，包括资产负债表、利润表和现金流量表，教导学生如何读懂和分析这些报表。

3 财务指标评估：介绍常用的财务指标，如市盈率、市净率、ROE 等，以及如何通过这

些指标评估公司的盈利能力、成长性和估值水平。

4 行业和竞争环境分析：了解行业的发展趋势和竞争格局，分析公司在行业中的地位 and 竞争优势，以及行业因素对公司业绩的影响。

5 宏观经济分析：掌握宏观经济指标的意义和影响，了解如何根据宏观经济变量预测行业和公司的发展趋势。

6 公司风险评估：评估公司面临的各种风险，包括市场风险、行业风险和公司特定风险，以及如何将这些风险考虑在投资决策中。

要求：能够读懂和分析资产负债表、利润表和现金流量表；能够评估公司的盈利能力、成长性和估值水平；能够评估公司面临的各种风险；能够根据基本面分析做出投资决策，并制定相应的投资策略。

实验 4：证券投资技术分析

目标：了解并掌握技术分析的基本方法和工具。

内容：

1 技术分析的基本概念：介绍技术分析的定義、原理和方法，以及与基本面分析的区别和联系。

2 技术分析工具：介绍常见的技术分析工具，包括 K 线图、移动平均线、相对强弱指数、MACD 等，以及如何使用这些工具进行分析和预测。

3 趋势分析：介绍趋势分析的基本原理和方法，包括趋势线的绘制、趋势的分类和判断，以及如何根据趋势进行交易决策。

4 形态分析：介绍形态分析的基本原理和方法，包括头肩顶、头肩底、多头排列、空头排列等几种常见的形态，以及如何进行形态识别和交易操作。

5 量价分析：介绍量价分析的基本原理和方法，包括成交量的变化对价格走势的影响，以及如何使用量价指标进行分析和预测。

要求：能够根据历史数据和图表分析市场趋势，预测未来价格走势。

实验 5：证券投资操作策略

目标：了解和掌握不同类型的投资操作策略，包括长期投资、短期交易和衍生品交易等，能够根据市场情况和个人投资目标选择合适的操作策略。

内容：

1 长期投资策略：介绍长期投资的概念和特点，包括价值投资、成长投资和指数基金投资等，以及如何进行基本面分析和选择优质股票。

2 短期交易策略：介绍短期交易的概念和特点，包括日内交易、趋势跟踪和技术分析等，以及如何进行技术分析和选取适当的交易时机。

3 衍生品交易策略：介绍衍生品交易的概念和特点，包括期货、期权和差价合约等，以及如何进行风险管理和利用杠杆效应进行投资。

4 资产配置策略：介绍资产配置的概念和原则，包括股票、债券、现金和其他资产的比例分配，以及如何根据风险偏好和投资目标进行资产配置。

5 投机和保值策略：介绍投机和保值的概念和方法，包括利用市场波动进行短期交易和使用衍生品进行风险对冲等。

要求：理解不同类型的投资操作策略，包括长期投资、短期交易和衍生品交易等。掌握基本面分析和技术分析的方法和工具，能够根据市场情况选择合适的分析方法。能够根据个人投资目标和风险偏好选择合适的投资操作策略，如长期投资、短期交易或资产配置等。具备制定投资计划和执行交易的能力，包括选股、择时、设置止损和止盈等操作技巧。能够进行风险评估和管理，了解不同操作策略的风险特点和对策。具备交易纪律和心理素质，能够坚守投资原则并保持冷静和理性的态度。能够根据市场变化和投资绩效进行策略调整和优化，及时修正错误和改进方法。

(三) 各实验项目对课程目标的支撑关系

实验项目名称	课程目标	1	2	3	
证券市场		√	√		
证券交易		√	√	√	
证券投资基本面分析		√	√	√	
证券投资技术分析		√	√		
证券投资操作策略		√	√	√	

四、课程思政教学设计

证券投资理论与实务课程可以融入思想政治教育的元素，以培养学生的思想政治素养。以下是一些思政教育在证券投资理论与实务课程中的体现方式：

法制思政：介绍证券市场的法律法规和监管机制，引导学生遵守相关法规和职业道德，增强法律意识和信仰。教授证券投资理论的同时，强调合规操作和风险控制的重要性，引导学生遵守法律法规，秉持道德底线，树立正确的道德观和伦理意识。

社会责任思政：引导学生认识到证券市场和投资行为对整个社会经济的影响，让他们了解到担负起社会责任的重要性。可以通过案例分析和讨论，让学生思考如何在投资过程中遵守社会伦理和道德要求。强调证券投资行为对社会的影响，引导学生关注社会责任和可持续发展，积极践行社会主义核心价值观。

创新创业思政：介绍证券市场的投资机会和创新模式，鼓励学生勇于创新和创业，培养敢于面对挑战和追求卓越的精神。

公民素质思政：引导学生树立正确的投资理念和价值观，注重个人品德和精神修养的提高，提高公民素质和社会责任感。

共建共享思政：鼓励学生积极参与证券市场建设和发展，强调合作共赢、共建共享的理念，促进社会和谐稳定和经济繁荣发展。

强调可持续投资：介绍可持续投资的概念和原则，让学生了解到投资不仅关乎经济回报，还要考虑环境、社会和治理等因素。通过讨论可持续投资的案例，培养学生对可持续发展的意识，并引导他们为社会和环境可持续发展做出贡献。

在教学过程中通过思政教学达到以下效果：

理解证券市场的基本原理和运作机制，掌握证券投资的基本知识和技能。

培养学生正确的投资理念和价值观，强化社会责任意识和法治意识，注重诚信经营和保护投资者权益。

培养学生的创新创业精神，培养敢于面对挑战和追求卓越的品质。

培养学生的公民素质和社会责任感，促进社会和谐稳定和经济繁荣发展。

通过以上方式，可以在证券投资理论与实务课程中融入思政元素，帮助学生树立正确的道德观和价值观，提升他们的社会责任感和伦理意识。这样的教育引导有助于培养具有高尚道德情操的证券投资从业人员。

五、课程考核

总评构成	占比	考核方式	课程目标				合计
			1	2	3		
X1	20%	平时表现			100		100
X2	30%	课堂作业	100				100
X3	50%	期终闭卷考核	40	40	20		100

六、其他需要说明的问题

无
