

课程大纲

课程编号：02819060 授课对象：研究生
课程名称：证券投资学 英文名称：Security Analysis and Investment
周学时/总学时：3/54 学 分：3
任课教师：张峥 开课学期：2013 春
先修课程：公司金融、统计学

任课教师联系方式：010-62767856, zheng86@gsm.pku.edu.cn

辅导、答疑时间：

一、项目培养目标

学习目标 1 教授学生最新的金融学、经济学和管理学的理论知识，培养学生综合运用理论知识和解决实际金融问题的能力。

具体目标 1 系统掌握金融学、经济学和管理学的理论知识

具体目标 2 掌握数量化与分析问题的能力

具体目标 3 能够综合应用所学的理论知识和方法解决实际问题

学习目标 2 培养学生良好的沟通能力，使之适应在各类金融机构和企业的工作。

具体目标 1 具备良好的口头交流

具体目标 2 具备良好的书面交流能力

具体目标 3 具备良好的团队合作精神

学习目标 3 具有良好的社会责任感和伦理道德观

学习目标 4 具有国际化的视野

具体目标 1 理解金融的商业环境存在文化差异

具体目标 2 了解全球不同的金融体系

具体目标 3 适应在跨国金融机构有效工作。

二、课程概述

本课程主要内容是以证券投资组合管理的决策实施过程（包括投资政策的制定、市场预期、证券分析、投资业绩评估方法）为主线，介绍投资学理论、方法以及应用，其中包括投资组合优化、均衡定价理论、交易成本分析、以及应用计算机软件实施金融数据分析等。

三、课程目标（包括学生所提高的技能要求），本课程目标如何服务于项目的培养目标

第一，理解金融市场的组织以及主要的功能；第二，掌握金融工具的价值评估方法；第三，

理解风险和收益的关系，和投资组合管理的原理；第四，应用基本理论进行投资分析和投资管理。

四、内容提要及学时分配

	内容	周	方式
第 1 部分	理性分析金融市场	1	讲授
第 2 部分	投资组合管理	2	讲授
第 3 部分	市场预期理论与应用	3-5	讲授
第 4 部分	资产配置策略	6-7	讲授
第 5 部分	择时策略	7-8	讲授
第 6 部分	股票投资价值分析	9	讲授
第 7 部分	交易成本管理	10	讲授
第 8 部分	投资业绩评估	12	讲授
第 9 部分	金融数据分析	13-15	讲授

五、教学方式

课堂讲授+计算实验+案例讨论

六、教学过程中 IT 工具等技术手段的应用

七、教材

Elton, Edwin J., Martin J. Gruber, et.al., Modern Portfolio Theory and Investment Analysis. Hoboken, NJ: John Wiley & Sons, Inc.

八、参考书目

九、教学辅助材料，如 CD、录影等

十、课程学习要求及课堂纪律规范

平时作业：学生必须按时完成作业，在课程指定的时间提交，推迟提交将不被接受。

分析报告：由教师分析课题，学生应用计算机软件分析金融数据，形成分析报告，并积极参与课堂讨论。

十一、学生成绩评定办法（需详细说明评估学生学习效果的方法）

课堂参与和平时作业:	20%
期中考试:	20%
期末考试:	60%

十二、项目培养目标的考核方式与标准（仅适用于参与保障教学效果评估 (Assurance of Learning) 的课程, 该部分可以由教务部门与任课老师沟通后填写, 认证涉及课程: 金融学概论、金融计量经济学 II、证券投资学、实证金融、货币金融理论、金融工程、管理学、微观经济学)