

## 课程教学进度计划表

### 一、基本信息

课程名称	证券投资理论与实务				
课程代码	0010120	课程序号	1603	课程学分/学时	2/32
授课教师	翁建伟	教师工号	21661	专/兼职	兼职
上课班级	工企 22-1、 22-2	班级人数	29	上课教室	四教 209
答疑安排	每周四晚四教 209 教室 21:15				
课程号/课程网站					
选用教材	《证券投资理论与实务》（第二版） 费玄淑著 东北财经大学出版社				
参考教材与资料	《证券投资分析》（第六版），赵锡军、魏建华 编，中国人民大学出版社 《证券投资分析》，证券业考试协会 著，中国金融出版社				

### 二、课程教学进度安排

课次	课时	教学内容	教学方式	作业
1	2	第1章 导论 介绍证券的定义及分类、有价证券的分析比较体系、股票的分类及比较、债券的分类及比较	讲课	
2	2	第2章 证券市场 掌握证券市场的运行机制及监管机制	讲课	
3	2	第3章 证券投资基本分析 讲授价值投资基本面分析	讲课	
4	2	第3章 证券投资基本分析 讲授价值投资财务面分析	讲课	
5	2	第4章 证券投资技术分析 讲授技术分析入门知识 如盘口语言等，并教授如何构建投资体系	讲课	课后模拟盘
6	2	第4章 证券投资技术分析 讲授技术分析的量和价相关知识	讲课	课后模拟盘
7	2	第4章 证券投资技术分析 讲授技术分析的线、形、位相关知识	讲课	课后模拟盘

8	2	第5章 证券组合管理 讲授证券组合的基础知识	讲课	
9	2	第5章 证券组合管理 掌握马科维茨选择资产组合核心要素	讲课	
10	2	第6章 风险资产的定价与证券组合管理的应用 掌握资本资产定价模型	讲课	
11	2	第6章 风险资产的定价与证券组合管理的应用 掌握套利定价理论和期权定价理论	讲课	
12	2	第7章 量化投资、大数据分析与智能投顾 讲授时下流行的量化投资方面知识	讲课	
13	2	第7章 量化投资、大数据分析与智能投顾 讲授大数据	讲课	
14	2	第8章 投资组合管理业绩评价模型 重点讲授单因素和多因素绩效评价模型	讲课	
15	2	第9章 债券组合管理 主要讲授如何玩转可转债	讲课	
16		整本书的知识体系串讲	讲课	

### 三、考核方式

总评构成	占比	考核方式
X1	20%	平时表现
X2	30%	课堂作业
X5	50%	期终闭卷考核

任课教师： 翁建伟 系主任审核： (签名) 日期： 2024-03-05