

《证券投资分析》

课程教学大纲

一、课程基本信息

课程类型	总学时为学时数	<input checked="" type="checkbox"/> 理论课（含上机、实验学时）			
	总学时为周数	<input type="checkbox"/> 实习 <input type="checkbox"/> 课程设计 <input type="checkbox"/> 毕业设计			
课程编码	7285111	总学时	48	学分	3
课程名称	证券投资分析				
课程英文名称	Analysis of Securities Investment				
适用专业	统计学				
先修课程	宏观经济学，统计学，证券市场				
开课部门	理学院统计系				

二、课程性质与目标

本课程是高等院校四年制本科统计学科的专业方向选修课，该课程注重理论与实践的结合，从国家经济基本面的角度对证券投资价值进行评价分析，在介绍当今流行的证券投资的基本技术分析方法的同时，结合个人实践经验及国外投资案例介绍投资策略及技术分析技巧，是一门学以致用课程，要求有经济学，统计学，证券市场，财务管理学等方面的基础知识，应用性比较强。

课程目标1：学生应掌握有价证券的投资价值分析、宏观经济分析、公司分析和行业分析方面的知识。

课程目标2：学生应能应用技术指标分析，K线理论，切线理论，形态分析，波浪理论等方面的技能，并通过今后在实践中的不断探索，大大提高投资技巧，成为成功的投资者。

课程思政目标：能够对我国证券市场的发展和进程有深刻的认识，为中国证券市场的更加完善做出贡献。

三、课程教学基本内容与要求

（一）证券投资分析概述

1、教学基本内容：

（1）证券投资分析概述

（2）证券投资分析的主要方法

2、教学基本要求：

（1）掌握证券投资分析的定义、意义

(2)掌握证券投资分析的主要方法

(二) 有价证券的价格决定

1、教学基本内容：

- (1)债券的投资价值分析
- (2)股票的投资价值分析
- (3)其他投资工具的投资价值分析
- (4)投资基金的价值分析

2、教学基本要求：

- (1)了解债券投资价值的影响因素、股票投资价值的影响因素
- (2)掌握债券的利率期限结构和价值评估
- (3)掌握股票内在价值的计算方法
- (4)掌握优先认股权、可转换债券以及认股权证的价值决定

(三) 证券投资的宏观经济分析

1、教学基本内容：

- (1)宏观经济分析
- (2)宏观经济分析的主要内容

2、教学基本要求：

- (1)了解宏观经济分析的意义、方法
- (2)了解评价宏观经济形势的相关变量
- (3)掌握宏观经济运行分析的基本原理、内容
- (4)掌握宏观经济政策分析的基本原理、内容

(四) 行业分析

1、教学基本内容：

- (1)行业分析的意义
- (2)行业划分的方法
- (3)行业的一般特征分析
- (4)影响行业兴衰的主要因素

2、教学基本要求：

- (1)了解行业分析的意义、行业划分的方法
- (2)掌握行业分析的一般特征
- (3)了解影响行业兴衰的因素、行业投资的选择方法

(五) 公司分析

1、教学基本内容：

- (1)公司基本分析

- (2)公司财务分析
- (3)其他重要因素分析

2、教学基本要求:

- (1)了解公司的行业地位分析方法
- (2)根据财务报表掌握财务比率的公式及分析方法
- (3)了解投资项目分析方法
- (4)掌握资产重组、关联交易的方式

(六) 证券投资技术分析概述

1、教学基本内容:

- (1)技术分析的理论基础
- (2)技术分析的要素:量、价、时、空
- (3)技术分析方法的分类和注意事项
- (4)证券投资技术分析的理论介绍

2、教学基本要求

- (1)掌握技术分析的理论基础
- (2)掌握技术分析的要素
- (3)了解技术分析方法的分类以及与其相关的理论

(七) K 线理论

1、教学基本内容:

- (1)K 线的画法和主要形状
- (2)单根 K 线的含义
- (3)K 线的组合形态
- (4)应用 K 线理论应注意的问题

2、教学基本要求:

- (1)了解 K 线的形状和主要画法
- (2)掌握单根 K 线的含义和 K 线的组合形态

(八) 切线理论

1、教学基本内容:

- (1)趋势分析
- (2)趋势线和轨道线
- (3)黄金分割线和百分比线
- (4)应用切线理论应注意的问题

2、教学基本要求:

- (1)理解趋势分析方法
- (2)掌握支撑线、压力线、趋势线、轨道线以及扇形原理

(3)了解黄金分割线、百分比线、速度线和甘氏线

(九) 形态理论

1、教学基本内容：

- (1)价格移动规律及两种形态类型
- (2)反转突破形态—头肩形、多重顶底形和圆弧形
- (3)反转形态和矩形形态
- (4)喇叭形、菱形、旗形、楔形和 V 形

2、教学基本要求：

- (1)了解价格移动规律及两种形态类型
- (2)掌握持续整理形态内容及分析方法
- (3)掌握反转突破形态内容及分析方法

(十) 波浪理论

1、教学基本内容：

- (1)波浪理论的形成历史及基本思想
- (2)波浪理论的主要原理
- (3)波浪理论的应用及其不足

2、教学基本要求：

- (1)了解波浪理论的基本思想
- (2)掌握波浪理论的主要原理

(十一) 技术指标理论

1、教学基本内容：

- (1)技术指标法概述
- (2)移动平均线 (MA) 和平滑异同移动平均线 (MACD)
- (3)威廉指标
- (4)KDJ 指标
- (5)乖离率 (BIAS) 和心理线 (PSY)
- (6)AR、BR、CR、OBV、TAPI、ADL、ADR 和 OBOS

2、教学基本要求：

掌握以下指标的意义及用法：MA、MACD、WMS%或 R%、KDJ、RSI、BIAS、PSY、AR、BR、CR、OBV、TAPI、ADL、ADR、OBOS 等

四、 课程学时分配

教学内容	讲 授	实 验	上 机	课内学时 小计	测验	课外 学时
------	--------	--------	--------	------------	----	----------

(一) 证券投资分析概论	2			2		
(二) 有价证券的价格决定	6			6		
(三) 宏观经济分析	4			4		
(四) 行业分析	2			2		
(五) 公司分析	2			2		
(六) 技术分析概论	4			4		
(七)K 线理论	2		2	4		
(八)切线理论	2		2	4		
(九)形态理论	4			4		
(十)波浪理论	2		2	4		
(十一) 技术指标理论	8		2	10		
合 计	38		8	46	2	

五、 实践性教学内容的安排与要求

从第七章开始，涉及技术分析部分的内容都需要上网，用股市实时行情作为案例介绍技术分析方法的使用并布置作业，利用行情来完成对行情的研判。具体安排见“四、课程各教学环节和各篇章（节）学时分配”。

六、 教学设计与教学组织

教学采用PPT，投影，多媒体演示等方式。在讲授理论知识的同时，结合股票债券基金等有色证券的实际行情进行案例教学。

七、 教材与参考资料

1. 教材：《证券投资分析》（第六版），赵锡军，魏建华主编，中国人民大学出版社，2015年4月出版
2. 参考资料：《证券投资学》（2012年版），陈跃主编，机械工业出版社。

八、 课程考核方式与成绩评定标准

成绩为百分制，平时占30%，期末考试成绩占70%，平时成绩包括考勤情况、作业情况，上机情况，及期中考试成绩。考试内容包括基本概念和基本原理，重点是有价证券的价格决定、公司的财务报表分析以及形态理论、切线理论及技术指标理论等，为各章要求“掌握”的内容。

九、 大纲制(修)订说明

大纲执笔人：周梅

大纲审核人：肖春来

开课系主任：刘喜波

开课学院教学副院长：李红梅

制（修）订日期：2022年2月