

《14654 证券投资理论与实务》

实践考核大纲

一、课程性质与考核目标

课程性质：本课程是金融学专升本专业的核心实践课，以应用能力培养为导向，兼具理论性与操作性。本课程主要揭示证券投资运行规律，内容包括证券投资工具、现代证券投资理论、证券投资分析及证券投资策略。课程立足中国多层次资本市场实际，强调“从概念到工具、从模型到实操”的能力转化，打破纯理论讲授模式，深度融合模拟交易、案例复盘、研报撰写、合规分析等实务环节，注重培养学生在注册制背景下识别证券产品、评估投资风险、运用技术与基本面方法、遵守行业规范的综合职业素养，体现专升本教育“夯实基础、强化应用、衔接岗位”的鲜明特点。

课程目标：通过该课程学习，考生可从宏观、中观、微观三个层面分析证券价格波动的原因，了解宏观经济变量对市场趋势的影响，把握行业周期变化所带来的投资机会，并能根据上市公司的经营状况选择合适的投资对象，同时掌握证券投资的基本分析方法和技术分析方法，包括价量、均线、K线、形态、波浪等，通过实验或案例，将投资分析方法运用于证券投资实务中，服务于政府部门、金融机构、证券机构、企业及个人从事投资活动的实践。

二、参考教材

《证券投资理论与实务》，王军旗、王海山主编，中国人民大学出版社，2024年5月第6版

三、考核内容和学习目标

第一章 证券投资概述

（一）学习目标与要求

- 1、明确证券、投资、证券投资、证券投资学的基本概念，证券、投资、证券投资的种类。
- 2、理解证券、投资、证券投资、证券投资学的特征。
- 3、掌握证券的功能与证券投资学的研究内容。

(二) 内容提要

- 第一节 证券
- 第二节 投资与证券投资
- 第三节 证券投资学

(三) 考核知识点

1. 证券的概念、种类、特征及其功能
2. 投资与证券投资的观念、种类
3. 证券投资学的观念与研究内容

(四) 考核目标和具体要求

1. 识记：证券、投资、证券投资、证券投资学的基本概念，证券、投资、证券投资的种类
2. 领会：证券、投资、证券投资、证券投资学的特征
3. 应用：证券的功能与证券投资学的研究内容

(五) 本章重点、难点

- 重点：证券、投资、证券投资、证券投资学的观念与特征
难点：证券的功能与证券投资学的研究内容

第二章 股票

(一) 学习目标与要求

1. 明确股票的概念、性质、类型与各国股票价格指数。
2. 理解股票价格、特征，股票价格指数。
3. 掌握股票投资收益与股票价格指数的编制。

(二) 内容提要

- 第一节 股票的概念和特征
- 第二节 股票的类型
- 第三节 股票的价格与收益
- 第四节 股票价格指数

(三) 考核知识点

1. 股票的概念和特征
2. 股票的类型
3. 股票的价格与收益

(四) 考核目标和具体要求

1. 识记：股票的概念、性质、类型与各国股票价格指数
2. 领会：股票价格、特征，股票价格指数的编制
3. 应用：股票投资收益与股票价格指数

(五) 本章重点、难点

重点：股票的类型、性质与特征，各国股票价格指数

难点：股票投资收益与股票价格指数的编制

第三章 债券

(一) 学习目标与要求

1. 明确债券的概念、特征和类型。
2. 理解债券的信用评级。
3. 掌握债券的利率和收益率。

(二) 内容提要

第一节 债券的概念和特征

第二节 债券的类型

第三节 债券的利率和收益率

第四节 债券的信用评级

(三) 考核知识点

1. 债券的概念和特征
2. 债券的类型
3. 债券的利率和收益率
4. 债券的信用评级

(四) 考核目标和具体要求

1. 识记：债券的概念、特征和类型
2. 领会：债券的信用评级
3. 应用：债券的利率和收益率

(五) 本章重点、难点

重点：债券的概念、特征和类型，债券的利率和收益率

难点：债券的利率和收益率

第四章 投资基金

(一) 学习目标与要求

1. 明确投资基金的概念和类型。

2. 理解基金投资的特征与主要角色。
3. 掌握投资基金的运营与管理。

(二) 内容提要

- 第一节 投资基金的概念和特征
- 第二节 投资基金的类型
- 第三节 基金投资中的主要角色
- 第四节 投资基金的运营
- 第五节 投资基金的管理

(三) 考核知识点

1. 投资基金的概念和特征
2. 投资基金的类型
3. 基金投资中的主要角色
4. 投资基金的运营与管理

(四) 考核目标和具体要求

1. 识记：投资基金的概念和类型
2. 领会：基金投资的特征与主要角色
3. 应用：投资基金的运营与管理

(五) 本章重点、难点

- 重点：投资基金的类型、特征与运营管理
难点：投资基金的运营与管理

第五章 金融衍生工具

(一) 学习目标与要求

1. 明确金融衍生工具的概念和类型、功能和特征。
2. 理解金融期货与金融期权的区别。
3. 掌握金融期货与金融期权的交易机制。

(二) 内容提要

- 第一节 金融衍生工具的概念和类型
- 第二节 金融衍生工具的功能和特征
- 第三节 金融期货
- 第四节 金融期权

(三) 考核知识点

1. 金融衍生工具的概念和类型
2. 金融衍生工具的功能和特征
3. 金融期货

4. 金融期权

(四) 考核目标和具体要求

1. 识记：金融衍生工具的概念和类型、功能和特征
2. 领会：金融期货与金融期权的区别
3. 应用：金融期货与金融期权的交易机制

(五) 本章重点、难点

重点：金融衍生工具的概念和类型、功能和特征，金融期货与金融期权的区别

难点：金融期货与金融期权的交易机制

第六章 证券市场

(一) 学习目标与要求

1. 明确证券市场的概念、种类、特征、功能与结构，证券交易所与证券场外市场，证券市场违法违规行为分类
2. 理解证券发行市场的构成与功能，证券交易市场结构与功能；证券市场监管的原则、方法与内容。
3. 掌握证券发行市场的证券发行方式与条件、发行的程序，证券交易方式与程序。

(二) 内容提要

- 第一节 证券市场概述
- 第二节 证券发行市场
- 第三节 证券交易市场
- 第四节 证券市场监管

(三) 考核知识点

1. 证券市场的概念、种类、特征、功能与结构
2. 证券发行市场的构成与功能，证券发行方式、条件与发行的程序
3. 证券交易市场结构与功能，证券交易方式与程序，证券交易所与证券场外市场

(四) 考核目标和具体要求

1. 识记：证券市场的概念、种类、特征、功能与结构，证券交易所与证券场外市场，证券市场违法违规行为分类
2. 领会：证券发行市场的构成与功能，证券交易市场结构与功能；证券市场监管的原则、方法与内容
3. 应用：证券发行市场的证券发行方式与条件、发行的程序，证券交易方式与程序

(五) 本章重点、难点

重点：证券交易所与证券场外市场，证券市场违法违规分类；证券发行市场的构成与功能，证券交易市场结构与功能；证券市场监管的原则、方法与内容

难点：证券发行市场的证券发行方式与条件、发行的程序，证券交易方式与程序

第七章 证券投资分析概述

(一) 学习目标与要求

1. 明确证券投资分析的作用和步骤。
2. 理解证券投资分析的方法。
3. 掌握证券投资收益与风险分析。

(二) 内容提要

- 第一节 证券投资分析的作用和步骤
- 第二节 证券投资分析的方法
- 第三节 证券投资收益分析
- 第四节 证券投资风险分析

(三) 考核知识点

1. 证券投资分析的作用和步骤。
2. 证券投资分析的方法。
3. 证券投资收益与风险分析。

(四) 考核目标和具体要求

1. 识记：证券投资分析的作用和步骤
2. 领会：证券投资收益与风险分析
3. 应用：证券投资分析的方法

(五) 本章重点、难点

重点：证券投资收益与风险分析

难点：证券投资分析的方法

第八章 证券投资基本分析

(一) 学习目标与要求

1. 明确证券投资基本分析框架。
2. 理解宏观、产业与公司分析方法。
3. 掌握证券投资基本分析的应用。

(二) 内容提要

第一节 宏观经济与政策分析

第二节 行业分析与区域分析

第二节 公司分析

(三) 考核知识点

1. 宏观经济与政策分析

2. 行业分析与区域分析

3. 公司分析

(四) 考核目标和具体要求

1. 识记：证券投资基本分析的概念

2. 领会：宏观、产业与公司分析方法

3. 应用：证券投资基本分析的综合应用

(五) 本章重点、难点

重点：证券投资的宏观、产业与公司分析方法

难点：证券投资基本分析的综合应用

第九章 证券投资技术分析

(一) 学习目标与要求

1. 明确证券投资技术分析的特点、假设前提、四大要素与局限性。

2. 理解技术分析道氏理论与波浪理论。

3. 掌握图形分析、切线分析、形态分析与指标分析。

(二) 内容提要

第一节 技术分析概述

第二节 技术分析理论

第三节 图形分析

第四节 切线分析

第五节 形态分析

第六节 指标分析

(三) 考核知识点

1. 技术分析概述

2. 技术分析理论

3. 图形分析

4. 切线分析

5. 形态分析

6. 指标分析

(四) 考核目标和具体要求

1. 识记：证券投资技术分析的特点、假设前提、四大要素与局限性

2. 领会：技术分析道氏理论与波浪理论

3. 应用：图形分析、切线分析、形态分析与指标分析

(五) 本章重点、难点

重点：证券投资技术分析的特点、假设前提、四大要素与局限性，图形分析、切线分析、形态分析与指标分析

难点：技术分析波浪理论

第十章 证券投资基本理论

(一) 学习目标与要求

1. 明确投资组合理论的产生与发展。
2. 理解套利定价理论。
3. 掌握投资组合理论与资本资产定价模型。

(二) 内容提要

第一节 投资组合理论

第二节 资本资产定价模型

第三节 套利定价理论

(三) 考核知识点

1. 投资组合理论
2. 资本资产定价模型
3. 套利定价理论

(四) 考核目标和具体要求

1. 识记：投资组合理论的产生与发展
2. 领会：套利定价理论
3. 应用：投资组合理论与资本资产定价模型

(五) 本章重点、难点

重点：投资组合理论与资本资产定价模型

难点：投资组合理论与资本资产定价模型的推导

四、题型：本门课程考试可选用的命题题型范围为辨析题、简答题、计算题、案例分析题。（考生可携带无存储功能的计算器）

五、命题要求

1. 本课程考试采用闭卷笔试形式，考试时间为 150 分钟。
2. 本课程在试卷中对不同能力层次要求的分数比例大致为：识记占 20%，领会占 30%，应用占 50%。

3. 要合理安排试题的难易程度，试题的难度可分为：易、较易、较难和难四个等级。每份试卷中不同难度试题的分数比例一般为：2:3:3:2。