

甘肃省高等教育自学考试 课程考试大纲

专业名称：金融学（专升本）

专业代码：020301K

课程名称：证券投资理论与实务（14653）



甘肃省高等教育自学考试委员会 制定

2024年3月

《证券投资理论与实务》自学考试大纲

1. 课程性质与设置目的

(1) 课程基本信息

课程名称：证券投资理论与实务

教材信息：徐伟川等. 证券投资学. 长沙：中南大学出版社. 2022

课程代码：14653

课程类别：统考课程

总 学 分：5

适用专业：金融学

(2) 课程的性质与任务

《证券投资与实务》课程是面向金融类专升本的专业课程。本课程主要介绍证券投资的基本理论、基本知识、证券市场运行的基本规律及其管理原则以及证券投资的一般技术和策略等。通过学习这门课程，使学生了解证券市场运行规律、熟悉证券监管的法制基础和相关的法律法规，掌握主要证券投资工具的特征、投资基本理论和基本方法，并具有一定的证券投资分析能力。

本课程的实践性较强，教师在授课过程中应注意理论与实践相联系。在讲授基本原理的基础上，能做到深入浅出，使学生在理论和实践方面都得到提高，同时培养学生的自学能力。

其前期课程主要有概率论及数理统计、金融学、会计学和财政学等。学好本课程亦将为后续证券投资方向的学习奠定必要基础。

(3) 课程学习目标

本课程的教学内容主要包括：

1. 证券市场：了解证券市场的发展历史；掌握证券市场的概念、结构和类型；掌握证券发行基本程序、证券交易的基本程序；了解股票价格指数的含义及编制方法、世界著名股票指数；了解证券市场监管机制；了解国内外主要证券市场的产生和发展历程。

2. 证券市场客体：掌握股票、债券、基金及金融衍生品的概念、分类、特点及市场运作。

3. 证券投资分析方法：掌握基本分析和技术分析的基本方法，具备一定的分析能力。

4. 证券投资组合管理理论：了解均值-方差分析法、资本资产定价模型、套利定价理论、期权定价理论等现代金融理论成果。

本课程具有一定教学实践特点的教学环节是实践练习。实践练习的主要内容和要求是（由任课教师具体安排）：

1. 要求学生选择一家上市公司作为研究对象。
2. 要求学生学会利用各类金融网站收集整理上市公司投资信息。
3. 运用证券投资软件（如大智慧等）进行基本分析和技术分析

2. 课程内容与考核目标

(一) 第1章 证券市场概述

【学习目标】

通过本章的学习，使学生达到以下学习目标：

1. 掌握证券、证券市场的含义和分类；
2. 熟悉证券发行与流通的基本原理；
3. 了解国内外证券市场的产生与发展过程。

【学习内容】

1. 证券概念及分类
2. 证券市场概念及分类
3. 证券发行市场
4. 证券流通市场
5. 国际国内证券市场的发展概况
6. 证券市场监管

【学习重点】

本章重点是证券、证券市场的含义和分类。

【学习难点】

本章难点是证券发行制度及证券交易流程。

第2章 股票

【学习目标】

通过本章的学习，使学生达到以下学习目标：

1. 掌握股票的概念、特征;
2. 掌握股票的分类;
3. 熟悉股票价格指数的含义及编制方法;
4. 掌握股票价格、价值的计算和估算方法。

【学习内容】

1. 股票概念及性质
2. 股票基本特征及分类
3. 股票的价值与价格
4. 股票价格指数

【学习重点】

股票的概念及性质、股票基本特征及分类。

【学习难点】

股票价值估算、股票价格指数。

第3章 债券

【学习目标】

通过本章的学习，使学生达到以下学习目标：

1. 掌握债券的概念及分类;
2. 掌握国债的特征、分类;
3. 掌握金融债券;
4. 掌握公司债券;
5. 掌握债券的结算和交易方式;

6. 了解债券的评级。

【学习内容】

1. 债券的含义与特征
2. 债券的分类
3. 债券的结算与交易方式
4. 债券评级

【学习重点】

本章的重点是债券的概念、分类与特征。

【学习难点】

本章的难点是债券的结算和交易方式、债券评级。

第 3 章 证券投资基金

【学习目标】

通过本章的学习，使学生达到以下学习目标：

1. 掌握证券投资基金的概念、分类及特征；
2. 掌握不同类型基金的特点；
3. 了解不同类型基金的运作过程；
4. 了解另类投资基金的基本情况。

【学习内容】

1. 证券投资基金的含义与特征
2. 证券投资基金的分类
3. 证券投资基金的运作与参与主体

* 4. 另类投资工具

【学习重点】

证券投资基金的含义与特征、证券投资基金的分类。

【学习难点】

证券投资基金的运作与参与主体、基金相关计算。

第 5 章 金融衍生工具

【学习目标】

通过本章的学习，使学生达到以下学习目标：

1. 掌握金融衍生工具的概念及特征；
2. 了解金融远期、金融互换；
3. 了解金融期货、金融期权的概念、分类及特征；
4. 了解期权类衍生工具的种类。

【学习内容】

1. 金融衍生工具概念及分类
2. 金融远期、期货与互换交易
3. 金融期权的概念、分类及特征
4. 期权类衍生工具的种类

【学习重点】

金融衍生工具概念及分类、远期与期货的对比、期货与期权的对比。

【学习难点】

金融期权的特征。

第 6 章 证券投资分析的方法与内容

【学习目标】

通过本章的学习，使学生达到以下学习目标：

1. 掌握证券投资分析的主要方法及其特点；
2. 掌握证券投资分析的主要内容及适用范围。

【学习内容】

1. 证券投资分析的主要方法及其特点
2. 基本分析的主要内容
3. 技术分析的主要内容

【学习重点】

证券投资分析的主要方法及其适用范围。

【学习难点】

基本分析主要内容及其特点、技术分析主要内容及其特点。

第 7 章 宏观经济分析

【学习目标】

通过本章的学习，使学生达到以下学习目标：

1. 了解宏观经济分析在证券市场投资中的作用；
2. 掌握宏观经济分析的主要方法；
3. 了解宏观经济运行对证券市场的影响；
4. 了解宏观经济政策对证券市场的影响力度和影响方向。

【学习内容】

1. 宏观经济分析的主要方法及指标
2. 宏观经济形势对证券市场的影响
3. 宏观经济政策对证券市场的影响

【学习重点】

宏观经济形势、宏观经济政策对证券市场的影响。

【学习难点】

宏观经济形势、宏观经济政策对证券市场的影响。

第 8 章 行业分析

【学习目标】

通过本章的学习，使学生达到以下学习目标：

1. 了解行业分类方法和类型；
2. 掌握行业的市场结构分析；
3. 掌握行业的生命周期分析；
4. 理解影响行业发展的主要因素；
5. 掌握行业选择策略。

【学习内容】

1. 行业及行业分类方法
2. 行业的一般特征分析
3. 影响行业发展的主要因素

【学习重点】

行业的一般特征分析；行业生命周期分析；影响行业发展的主要因素。

【学习难点】

行业的市场结构分析、生命周期分析、行业选择策略。

第 9 章 公司分析

【学习目标】

通过本章的学习，使学生达到以下学习目标：

1. 了解公司基本分析的主要内容；
2. 掌握公司基本分析方法；
3. 掌握公司财务报表；
4. 掌握公司财务报表分析的方法；
5. 了解公司财务状况综合分析方法；
6. 了解公司重大事项分析的主要内容。

【学习内容】

1. 公司基本分析方法
2. 公司财务报表的内容
3. 公司财务报表分析内容
4. 公司财务比率分析
5. 公司财务状况综合分析方法
6. 公司重大事项分析的主要内容
7. 公司价值分析。

【学习重点】

公司财务比率分析、公司财务状况综合分析。

【学习难点】

公司价值分析（相对估值法、绝对估值法及其计算）。

第 10 章 技术分析概述

【学习目标】

通过本章的学习，使学生达到以下学习目标：

1. 了解技术分析的基本概念特点和种类；
2. 掌握技术分析的三大假设；
3. 掌握技术分析的基本要素。

【学习内容】

1. 技术分析的基本概念特点和种类
2. 道氏理论
3. 技术分析的三大假设及其相互关系
4. 技术分析的基本要素
5. 量价理论

【学习重点】

技术分析的基本方法和特征、技术分析的三大假设、技术分析的对象。

【学习难点】

量价理论。

第 11 章 技术分析的主要理论

【学习目标】

通过本章的学习，使学生达到以下学习目标：

1. K 线及 K 线组合的画法及应用；
2. 切线理论、支撑压力线、趋势线、轨道线等切线的画法及应用；
3. 掌握反转突破形态、持续整理形态的确认标准及应用；
4. 了解波浪理论的主要内容。

【学习内容】

1. 掌握 K 线及 K 线组合的画法及应用
2. 掌握支撑线、压力线、趋势线、轨道线等切线的画法及应用
- * 3. 扇形理论、甘式线、速度线
4. 形态理论
5. 常见反转突破形态、持续整理形态的确认标准及应用
- * 6. 波浪理论的主要内容

【学习重点】

本章的重点是 K 线及 K 线组合的应用、切线的画法及应用、形态的确认及应用。

【学习难点】

K 线组合的画法及其应用、切线的画法及其应用、常见形态的确认及其应用、波浪理论。

第 12 章 常用技术指标

【学习目标】

通过本章的学习，使学生达到以下学习目标：

1. 了解技术指标的含义；
2. 熟悉技术指标编制的基本原理；
3. 掌握各种技术指标的应用法则及其在实战中的应用。

【学习内容】

1. 技术指标的含义及应用原则
2. 趋势类指标的基本原理及应用
3. 均线法则
4. 超买超卖类指标的基本原理及应用
5. 大盘类指标的基本原理及应用
6. 人气类指标的基本原理及应用

【学习重点】

本章的重点是各种指标的应用法则及其在实战中的应用。

【学习难点】

本章的难点是各种指标在实战中的综合应用。

第 13 章 证券投资基金管理理论

【学习目标】

通过本章的学习，使学生达到以下学习目标：

1. 了解风险与收益的基本概念；

2. 掌握证券投资组合管理理论；
3. 掌握资本资产定价理论；
4. 掌握套利定价理论；
5. 了解期权定价理论；
6. 掌握证券投资的基本策略。

【学习内容】

1. 均值--方差分析的基本概念
2. 资本资产定价模型
- * 3. 套利定价理论
- * 4. 期权定价理论
5. 证券投资的基本策略

【学习重点】

均值--方差分析的基本概念、资本资产定价模型、套利定价理论。

【学习难点】

均值--方差分析的基本概念、资本资产定价模型、套利定价理论、期权定价理论。

3. 有关说明与实施要求

本课程具有较强的理论性和实践性，学习过程中需注意理论联系实际。注重关注市场实际运行，关注相关国家法律、法规及相关政策方针的调整。注意通过实际案例加深对相关理论的理解，增强运用理论工具发现实际问题，分析问题，解决问题的能力。

自学总时长建议 216 课时。

社会助学者应根据本大纲规定的考试内容和考核目标，认真钻研指定教材，对自学应考者进行全面系统的辅导，把握正确导向。建议指导时长：54 学时。

课程中星标（标注 *）部分对自学考试学生而言难度偏大，建议授课中结合实际情况酌情讲授。

本课程考试采用闭卷考试的形式，满分 100 分，60 分及格，考试时间 150 分钟。考生可携带签字笔、铅笔、橡皮、无记忆储存功能及通讯功能的计算器参加考试。

合理安排试卷难易程度。本课程在试卷中对不同难易程度要求的分数比例大致为：易：较易：难：较难=2: 3: 3: 2。

本课程考试试卷采用的主要题型有：单项选择题、多项选择题、判断正误题、名词解释题、简答题、计算题、论述题等。

参考书目

- [1] 吴晓求. 证券投资学（第 5 版）. 北京：中国人民大学出版社. 2020
- [2] （美）博迪等. 投资学（第 9 版）. 北京：机械工业出版社. 2012
- [3] （美）法博齐等. 金融市场与金融机构基础（第 4 版）. 北京：机械工业出版社. 2010
- [4] （美）坎宁安. 向格雷厄姆学思考，向巴菲特学投资. 北京：机械工业出版社. 2011
- [5] （美）迈克尔·波特. 竞争战略. 北京：华夏出版社. 2012

[6] (美) 爱德华兹等. 股市趋势技术分析 (第 9 版). 北京: 机械工业出版社. 2010

[7] 中国证券业协会. 金融市场基础知识. 北京: 中国财政经济出版社, 2020

[8] (美) 艾略特. 波浪理论经典. 天津: 天津社会科学出版社, 2012

[9] 李向科. 证券投资技术分析. 北京: 中国人民大学出版社, 2015