**2019至2020学年 第 二 学期**

教 学 日 历

课程名称＿ **专业实习**＿性质 **必修课**

总学时＿64 ＿讲课＿64 实验＿ 0 ＿其它＿

授课班级  **2016级数学本科** 学生人数 **40人**

任课教师 **彭晓明** 职称 **讲师**

所在院(系、部) **理学院数学系**

系(教研室)主任签字 **高阳**

　　　　教材名称：《证券组合与投资分析》作者：欧阳光中 李敬湖

《数理金融学》 雍炯敏 刘道百

　　　　出版单位：高等教育出版社　　　出版时间：**1997**

上海人民出版社  **2003**

中国石油大学(北京)教务处制

填 写 说 明：

1．每上一次课填写一行，例如：一周上三次课填写三次；

2．教学日历一经制订，不应出现大的变动，但允许主讲教师在完成课程教学大纲规定的教学要求前提下，进行必要的调整，以适应不断出现的新情况．如有变动，须经课程所属系主任（教研室主任）批准，并报院（系、部）办公室备查．

3．上机、大作业、课堂讨论、外出参观、考试等如占课内学时，在“备注”栏内注明．

4．教学日历由教师自存一份、课程所属系存一份，在每学期开学后第一周内送课程所属院（系、部）办公室并发一份电子版给课程所属院（系、部）办公室；有实验和上机学时的须发一份电子版的给实践科sjk@cup.edu.cn

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 教学时间 | | | 授课内容提要 | 周学时  (周学时大于2，可合并单元格) | 学时分配 | | | 备注 |
| 周  次 | 星  期 | 节  次 | 讲课 | 实验 | 习题 |
| 次数 授课日期 所授内容 |
| **1** | 二 | 3456 | 金融的本质，金融市场分类，货币市场，外汇市场，证券市场，期货市场，贵金属市场，保险，信托等介绍 | 16 | 16 |  |  |  |
| 三 | 3456 | 股份制的本质，欧洲经济史，企业所有权与经营权的分离，有限责任公司介绍 |
| 四 | 3456 | 公司的风险控制，风险控制手段，经营多元化与风控的关系 |
| 五 | 1234 | 国外资本市场的现状，美国和欧洲道路的不同点，法律和信托责任对资本市场的影响，中国诚信体制的建立 |
| **2** | 二 | 3456 | 1. 证券组合   1，收收益与风险  2，组合的收益与风险，有效前沿 | 16 | 16 |  |  |  |
| 三 | 3456 | 3，无风险证券与风险证券的组合  复习第一章 |
| 四 | 3456 | 第二章 资本资产定价模型和套利定价理论  1，概括的描述  2，资本资产定价模型 |
| 五 | 1234 | 3，特征线  4，因素模型 |
| **3** | 二 | 3456 | 第三章 证券的评价  1，普通股股票的评价2，债券的评价 | 16 | 16 |  |  |  |
| 三 | 3456 | 3，投资管理和投资评价 |
| 四 | 3456 | 第四章 外汇市场和证券市场  1，切点组合的计算方法一，  切点组合的计算方法二，  分离定理与切点组合的关系  2, 市盈率Pe，市盈率对证券定价的影响，  市净率Pb，市净率对证券定价的影响  证券的合理估值范围  股票的内在价值 |
| 五 | 1234 | 3. 股票价格模型  4. 美式期权定价  5. 敲出期权定价  6. 回望期权定价 |
| **4** | 二 | 3456 | 第五章 期货与期权  1，股票价格模型 | 16 | 16 |  |  |  |
| 三 | 3456 | 2，用二叉树模型进行看涨期权定价  3，美式期权定价和敲出期权定价 |
| 四 | 3456 | 4，回望期权定价  5，实证数据下二叉树模型分析 |
| 五 | 1234 | 总复习 |