

中国计量学院

《证券投资学》课程设计》 ——指导书

二级学院（部、中心） 经济与管理学院

学 科 （ 专 业 ） 财务与管理

课 程 名 称 证券投资学课程设计

授 课 对 象 财管、国贸、工商

教 材 名 称 《证券投资学》（吴晓求主编）

一、 实验目的

充分应用证券行情客户端软件（主要使用“广州证券”行情及交易软件）与期货行情客户端软件（主要使用“博易”行情及交易软件），改变传统的教学手段和教学方法，将软件的应用引入到证券投资学的教学和实践中来，实现理论和应用相结合。使学生能熟练使用行情及交易软件进行决策和投资，并力争达到基本分析与技术分析的较完美结合，尽量减少决策的盲目性，降低投资的失误性。

二、 实验环境

要求人手一台电脑，每台电脑安装“广州证券”行情客户端软件和“博易大师”期货行情客户端软件。在进行股票与期货模拟交易时，自行下载模拟交易软件，建立自己的模拟交易账户。

三、 实验要求

总计上机时间 16-18 课时。从基本分析到技术分析逐渐展开。

上机期间，要求学生上交书面作业 5-7 次。作业成绩按照 A⁺、A⁻、A、B⁺、B 五个档次打分。上机的作业成绩和平时的出勤占到期末总成绩的 50%。

上机期间，要求学生充分认识课内实践对培养自己的重要性，认真做好上机前的各项准备工作。独立按时完成规定的工作任务，不得弄虚作假，不准抄袭他人内容。无故缺席按旷课处理；缺席时间达三分之一以上者，其作业成绩按零处理。

四、 实验内容和步骤

实验共分两个大的阶段进行。第一阶段为基本面分析，主要围绕股票市场，以宏观分析、行业分析与公司分析为手段，重点熟悉与使用“广州证券”行情客户端软件与模拟交易软件。第二阶段为技术分析，主要围绕商品与金融期货市场，以 K 线分析、切线理论、形态理论、各种技术分析指标为手段，重点熟悉与使用“博易大师”期货行情客户端软件与模拟交易软件。具体实验步骤如下：

（一）基本面分析

上机基本要求：

1. 打开桌面上的广州证券交易软件；
2. 迅速浏览广州证券、和讯期货网站，搜狐及新浪网站的财经信息等。
3. 点击广州证券交易软件行情版面上的各个菜单，逐渐熟悉软件的使用。
4. 在熟悉使用的基础上，设立自己的股票模拟交易账户并进行模拟交易。
5. 请对当前上海与深圳证券交易所内交易的所有证券的类别及数量进行统计。

作业一

若你有闲置资金 10 万元，正在找寻投资机会。朋友 A 建议说，现在是很好的入市机会，希望你投资股市；朋友 B 则说，现在行情扑朔迷离，不宜入市。请你作出自己的判断。要求：1. 以可行性分析报告的形式撰写投资分析书，字数不少于 500 字；2. 从影响股市的宏观因素方面展开分析；3. 要求言简意赅，行文朴素；4. 下课时，要将作业交上来。

作业二

假如你是证券公司的客户经理，有客户向你咨询，请你以投资分析报告的形式帮忙作出股票组合投资建议。要求：1. 首先选行业。请以产业生命周期理论为基础分析；2. 每个行业初选三只股票。选股依据：净资产收益率、主营业务收入增长率、市盈率；3. 依据上述三个财务指标，从每个行业终选一只股票，最后，形成三只股票的投资组合；4. 在具体选择时，请列出每只股票的上述三个财务指标的数据。5. 下课时上交书面作业。

作业三

1. 找出相应的数据，绘制“上证指数”9月1日-10月16日的周K线图；绘制“中国工商银行”9月16日以来连续一个月的日K线图。2. 要求：画图时，把格子图分为上下两部分，上半部绘制上证指数，下半部绘制中国工商银行；数据表列在格子图的后边空白部分，也可以单独写在其他纸上。3. 下课时上交书面作业。

（二）技术分析^①

上机基本要求：

1. 打开桌面上的“博易软件”、广州证券交易软件；2. 博易软件：帐号——zdqh, 密码 1234567. 3. 迅速浏览广州证券、和讯期货网站，搜狐及新浪网站的财经信息等。4. 熟悉上海期货交易所、郑州期货交易所、大连期货交易所交易的期货品种。重点熟悉博易交易软件的各项功能。把自己需要的各项大盘指数、主要期货品种放入“我的板块”。

作业一

1. 打开博易软件，把自己需要的各项大盘指数、主要期货品种放入“我的板块”。2. 安装以下软件：中大期货网站——软件下载——中大期货模拟交易软件（第一个），建立自己的模拟交易账户。请一定记住：新申请的用户名和密码！3. 重点熟悉上海期货交易所“天然橡胶 1103”、郑州期货交易所“白糖 1105”、大连期货交易所“豆油 1109”三个期货合约，掌握期货合约基本的内容、交割条件等。可以打开“中大期货专栏”进入公司门户网站后，选择“培训

^① 具体交易品种因时间的不同会有所变化。

学院”，了解有关合约的基本信息。4. 通过模拟交易账户试着“做多”（即首次交易方向是买进开仓）豆油期货 1109 合约。按账户资金的 20%交易。要求，下课时，不留仓位，即所有合约全部平仓。

作业二

1. 通过已经设立的模拟交易账户试着“做空”（即卖开仓）豆油期货 1109 合约。按账户资金的 20%交易。2. 要求：在交易时间内，完成两笔交易，即开仓—平仓为一笔交易。下课时，不留仓位，即所有合约全部平仓。3. “开仓—平仓”的操盘理由，请以 y1109 的 5 分钟 K 线结合 KDJ 指标进行判断。4. 下课时，请把每一笔操作的过程及理由以书面作业的形式上交。

作业三

1. 在进行模拟期货交易时，最少完成两种期货合约的两笔交易，每一笔交易由“开仓——平仓”两个交易过程才能完成；交易方向包括“买入开仓——卖出平仓”或“卖出开仓——买入平仓”两个交易方向。具体方向自己选择。2. 交易品种：豆油 1109 合约、沪铜 1102 合约。3. 每一笔交易，即无论开仓或平仓，都要说明交易理由。请依据 K 线理论说明。4. 具体到日内交易时，请主要参阅日 K 线、5 分钟 K 线、KDJ 指标。

作业四

1. 以豆油 1109、沪铜 1102、白糖 1109 合约为主要品种，进行期货模拟交易。2. 在进行模拟期货交易时，希望在课间完成两笔交易，每一笔交易由“开仓——平仓”两个交易过程才能完成；交易方向包括“买入开仓——卖出平仓”或“卖出开仓——买入平仓”两个交易方向。3. 每一笔交易，即无论开仓或平仓，都要说明交易理由。具体到日内交易时，请主要参阅日 K 线、分钟 K 线，以及 KDJ、MACD、和 MA 指标。4. 下课时，上交书面作业！

作业五

1. 继续以豆油 1109、沪铜 1102、白糖 1109 合约为主要品种，进行期货模拟交易。2. 每一笔交易，即无论开仓或平仓，都要有充分的交易理由。具体到日内交易时，请主要参阅日 K 线、分钟 K 线，以及 KDJ、MACD、和 MA 指标。重点理解开仓与平仓的方向！

作业六（小组竞赛）竞赛须知

1. 建好组别，可两人或三人一组，具体自定。2. 快速下载期货模拟交易软件，建好每组的账户。请牢记自己组别的用户名和密码。3. 把自己组别的成员名单和账户名及密码上交一份给我。4. 竞赛成绩按照账户盈余（亏损）账面余额及操盘手法判定，一等奖取一组，二等奖取两组，三等奖取三组。具体奖励办法再议。