

课程大纲

课程名称：保险资金运用

任课教师：许荣、何林

授课对象：保险专业本科生

开课学期：2016 学年春季

授课时间：9 周/周二 14:00—17:30

周学时/总学时：4/36

学 分：2

先修课程：证券投资学及保险学

授课地点：2207

联系方式：办公室：明德主楼 721；Email: xurong@ruc.edu.cn

辅导、答疑时间：周三上午 9 点--11 点，或者

根据同学预约时间安排答疑

一、课程概述

以保险机构为代表的机构投资者及其管理资产的迅猛发展是现代经济生活的重要特征之一。本课程致力于理解保险资金运用管理及机构投资者运行的整体运转，分析这一领域涌现出的大量现象。课程的定位是保险投资理论与市场操作的中间点，侧重于以投资学理论分析保险资金运用的组织与结构，以及这一领域发展中出现的各种问题。课程的各部分既重视对全球金融市场为对象的一般金融现象的分析，再辅之以中国市场或机构的发展与问题探讨。

二、课程目标

在课程结束时，学生应该能够：

1. 具有一定的分析机构投资者大幅增长现象的能力。
2. 了解中国保险资金运用的现状及主要问题。
3. 理解投资基金的种类、结构以及主要热点问题的解释：如基金表现，封闭性基金折价等。
4. 明显提高口头与书面分析机构投资管理问题的能力。

三、内容提要及学时分配

课程安排	内容
1	全球金融体系及机构投资增长概论
2	保险公司经营管理视角的保险投资
3	投资价值分析一

4	投资价值分析二
5	课堂展示与讨论：巴菲特给股东的信
6	基金投资
7	固定收益投资一
8	固定收益投资二
9	期末考试

四、教学方式

课堂讲授为主，鼓励同学们积极发表自己的看法。同时开展案例研究与互动讨论，个别章节将邀请金融业界成功人士参与讨论并要求同学进行独立研究并做分组课堂展示。

五、教学过程中 IT 工具等技术手段的应用

课程提供 PowerPoint 讲义。

随时利用最新的财经网站新闻资源进行讨论，包括新闻事件与最新金融统计数据。

利用国泰安及万得等数据库提供的数据库资源，经处理后进行演示教学。

六、教材

1. Madura, Jeff, *Financial markets and institutions*, 7th edition, 北京大学出版社, 2008。
2. 吴晓求, 《中国资本市场分析要义》, 中国人民大学出版社, 2006
3. 曹凤岐, 贾春新, 《金融市场与金融机构》, 北京大学出版社, 2002。

七、参考书目

1. 安东尼·桑德斯, 马西娅·米伦·科尼特, 《金融市场与金融机构》, 王中华译, 人民邮电出版社, 2006。
2. Kidwell, David S. *Financial institutions, markets, and money*, 9th edition, Hoboken, NJ : Wiley & Sons, c2006.
3. 彼得·S·罗斯著, 陆军主译, 《货币与资本市场》, 中国人民大学出版社, 2006。
4. 英格·沃尔特, 罗伊·C·史密斯著, 黄金老, 曾超, 刘伟译, 《全球资本市场与银行业》, 中国人民大学出版社, 2006。
5. Fabozzi, Frank J. and Modigliani, Franco, *Capital Markets: Institutions and Instruments*, 3th edition. Prentice Hall, New Jersey, 2002.
6. 和讯财经新闻网站。地址: <http://news.hexun.com/>

八、教学辅助材料, 如 CD、录影等

九、课程学习要求及课堂纪律规范

学生须完成课程规定的作业。

不接受以邮件形式提供的作业。超过规定时间一周缴纳的作业不再接受。

十、学生成绩评定办法

课堂参与:40%

期末闭卷考试: 60%