

수업계획서

투자론 (Investment)

담당교수	성명	이주희	교과목	주수강대상	학과	경영학과
	직위	명예교수			전공	재무
	소속	경영학과				

1. 교과목 개요

평균수명이 늘어나면서 효율적이고 안정적인 개인자산관리가 매우 중요한 시대를 맞이하고 있다. 은퇴후 장기간 안정적 생활을 영위하기 위해서 금융자산을 활용한 적극적인 자산관리가 필요하다. 현실에서는 '이렇게 하면 돈을 벌 수 있다'고 유혹하는 전문가와 투자 서적이 넘쳐나고 있지만, 일반인들이 쉽고 단순한 방법으로 장기적으로 안정된 투자 수익을 얻을 수 있는 전략을 배우기는 어려워 보인다. 많은 투자자들 역시 대박의 꿈에서 쉽게 벗어나질 못하며, 루머성 정보에 의존하는 비합리적 투자 의사 결정을 하고 증권회사 직원이나 증권 방송 전문가에 의존하여 귀중한 자산을 잃는 경우를 자주 보게 된다. 이 과목은 개인 투자자들의 실패 위험을 피해갈 수 있는 안내자의 역할을 하고, 경제적 독립을 달성하고 유지하며 편하게 벌고 잘 수 있는 최적의 투자전략을 찾는 과정이다.

2. 수업운영방법 개요

이 과목은 경영대학원의 투자론 과목으로 투자 이론을 토대로 투자 역사, 투자 심리, 투자 산업의 구조와 행태를 이해하고, 위험을 관리하는 기법들을 학습하여 합리적인 투자 의사 결정 능력을 배양하도록 구성되었습니다. 수학적으로 기술되는 어려운 금융 이론들을 비전공자도 쉽게 이해할 수 있도록 하였고, 주식 자체에 얽매이기 보다는 직관적으로 이해해서 실무에 적용할 수 있도록 하였습니다. 또한, 이론에 그치지 않고 실제 시장 데이터를 이용하여 실질적인 결과를 도출할 수 있는 실습 과정을 포함하고 있습니다.

3. 학습평가방법

수업참여(출석) 15%
과제물 20%
프로젝트 25%
중간고사 20%
기말고사 20%

4. 교재 및 참고자료

구분	교재 제목(웹사이트)	저자	출판사	출판년도
부교재	증권투자의 실제 제6판	신지숙 이해영 홍영복	탐진	2019

수업 계획서

4. 교재 및 참고자료

구분	교재 제목(웹사이트)	저자	출판사	출판년도
참고자료	Money 머니 - 부의 거인들이 밝히는 7단계 비밀	토니 로빈스 (지은이), 조성숙 (옮긴이), 정철진 (감수)	알에이치코리아(RHK)	2015
부교재	100세 인생의 자산관리 정석	정대용	탐진	2019
부교재	시장변화를 이기는 투자	버튼 맬킬 / 이건, 김홍식	국일증권연구소	2009
부교재	투자의 네 기둥(The four pillars of investing)	윌리엄 번스타인 / 박정태	굿모닝북스	2009
부교재	주식투자 ETF로 시작하라 실전 ETF 투자 매뉴얼	systrader79, 이성규	이레미디어	2018
부교재	할수있다! 퀀트투자	강환국 저/신진오 감수	에프엔미디어	2017
부교재	듀얼 모멘텀 투자 전략	게리 안토나치 저/서태준, 강환국 역/신진오 감수	에프엔미디어	2018
참고자료	마법의 돈 굴리기	김성일	에이치21	2017
참고자료	모든 주식을 소유하라	존 보글 저/이은주 역	비즈니스맵	2019
참고자료	현명한 자산배분 투자자	윌리엄 번스타인 저/김성일 역	에이지21	2019
참고자료	20대에 시작하는 자산관리 프로젝트	영주 닐슨	비썬크	2019
참고자료	그들이 알려주지 않는 투자의 법칙	영주 닐슨	위즈덤하우스	2018
참고자료	재무제표 모르면 주식투자 절대로 하지마라	사경인	베가북스	2016
주교재	거인의 포트폴리오 월급을 쪼개서 경제적 자유를 만드는 23가지 전략	강환국	페이지2북스	2021
부교재	주식하는 마음	홍진채	유영	2020
부교재	사경인의 친절함 투자 과외 - 내가 없어도 투자를 이어갈 가족을 위해 진심으로 전하는 투자 이야기	사경인, 이지영	페이지2	2021
부교재	절대수익 투자법칙	김동주	이레미디어	2020
참고자료	아빠와 딸의 주식투자 레슨	대니얼 타운	에프엔미디어	2018
참고자료	나는 당신이 주식 공부를 시작했으면 좋겠습니다 보이지 않는 세상에서 투자하는 법	이효석	페이지2	2021
참고자료	퀀트 전략 파이썬으로 세워라 누구나 시작할 수 있는 파이썬 퀀트 투자 첫 단추	박준규	BJ퍼블릭	2019
참고자료	파이썬으로 배우는 포트폴리오 금융공학/퀀트 투자의 기초부터 투자 모델, 머신 러닝까지	곽승주	길벗	2021
참고자료	R을 이용한 퀀트 투자 포트폴리오 만들기 데이터 크롤링 및 분석, 퀀트 전략을 활용한 투자 종목 선정까지	이현열	제이펍	2019

수업 계획서

4. 교재 및 참고자료

구분	교재 제목(웹사이트)	저자	출판사	출판년도
참고자료	미국 주식으로 시작하는 슬기로운 퀀트투자	김용환 , Yubin Kim	한빛미디어	2021

5. 수업 진도 계획

주별	교수내용	수업형태	비고
1	투자론의 기초개념과 최근동향		
2	금융시장과_금융상품		
3	증권시장의_구성과_운용		
4	위험과 수익률		
5	투자 의사결정 방법론		
6	포트폴리오이론		
7	CAPM		
8	중간고사		
9	Portfolio Visualizer		
10	효율적_시장가설		
11	성과평가		
12	왜 투자자들은 실패하는가?		
13	실전 투자 전략		
14	모멘텀 투자 전략		
15	가치투자자과 종목선정		
16	프로젝트 발표		

6. 기타 참고사항