

# 华南师范大学

## 专业学位硕士研究生培养方案

专业学位类别（领域）中文名称：金融硕士

专业学位类别（领域）英文名称：Master of Finance

专业学位类别（领域）代码：0251

培养单位名称：华南师范大学

填表日期：2021年5月10日

华南师范大学研究生院制表

## 一、学科概况

本专业学位于 2014 年获得授权，于 2015 年开始招生，目前拥有校内导师 27 人，行业导师 76 人。在人才培养过程中，形成了鲜明特色和优势。

①生源充足，质量优秀。本专业学位考录比为 12:1，第一志愿录取率为 100%。

②坚持“以赛促学”、“以证促学”，锻炼学生的金融知识综合运用能力。鼓励学生积极参加各类金融学科竞赛和 CFA、FRM 等金融类国际性资格考试。

③坚持理论教学和案例教学相结合。鼓励教师撰写课程教学案例，并运用案例讲解理论知识，已有 13 篇教学案例在全国金融教学案例大赛中获奖。

④分工合理的双导师制（校内导师+行业导师）提升了学生的金融实践能力。行业导师负责实习安排、毕业论文选题等工作，提高了学生运用金融理论解决金融实践问题的能力，使得我校的金融硕士毕业论文的选题面非常广，而且都是来自于具体的金融实践。已有 4 篇毕业论文在全国优秀金融硕士学位论文评选中获奖。

## 二、培养方向

培养方向 1: 金融分析师

金融分析师方向是我校经济与管理学院金融硕士的招生方向。该方向结合粤港澳大湾区的战略地位和广州、深圳的金融现状与社会需求，侧重于运用经济学和金融学理论来分析金融实践问题，比如金融案例分析、金融产品设计、金融实践调研等。

培养方向 2: 量化投资与数量金融。

量化投资与数量金融是我校数学科学学院金融硕士的招生方向。该方向侧重于通过海量的数据客观分析决策，并运用数学工具来寻找证券价格变动规律，进而对金融市场进行分析和判断，并建立证券交易的策略和算法。

### 三、培养目标

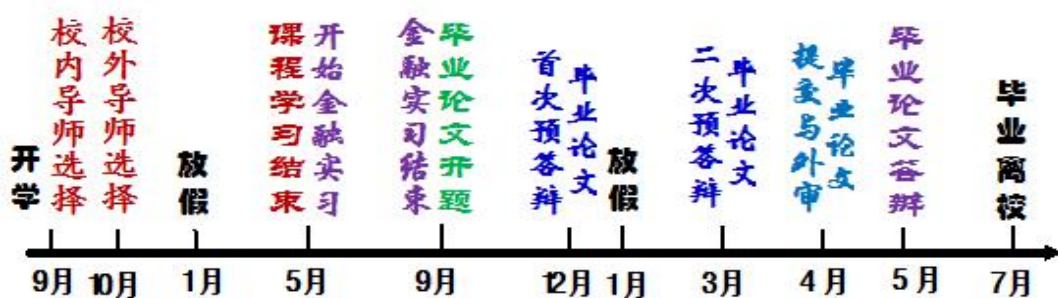
培养热爱祖国、遵纪守法、身心健康、维护社会主义制度，具备健全人格、良好的心理素质与合作精神，具备创新精神、创业意识和创新创业能力，具有坚定理想信念，品德优秀，系统掌握扎实的金融专业基础和相关技能，较强的从事金融实际工作能力的高层次、应用型金融专门人才。

要求学生：①要有良好的意识观念，如国际意识，广州粤港澳大湾区的核心城市之一，紧紧接轨国际，金融业的很多规则也是全球通用的，所以需要学生善于学习，善于借鉴。②要拥有创新能力，金融的灵魂是创新，广州作为一个思想极其开放和包容的城市，创新理念是必不可少的。③要具有服务精神，金融行业作为一个服务业，需要发挥良好的服务精神为行业做贡献。

### 四、学制和在校学习年限

采取全日制学习方式，学制为 2 年，其中在校学习时间累计不少于 1.5 学期。

本专业学位的时间安排如下：



## 五、培养方式

金融专业硕士培养方式采取全日制培养方式。课程学习应与专业实践相结合，课程学习主要在校内完成，专业实践主要在联合培养实践基地完成。

培养过程实行双导师制，以校内导师为主，充分发挥校外导师的作用，让校外导师参与专业实践和学位论文指导等工作。校外导师主要负责学生的教学实习安排、毕业论文选题等工作。校内导师主要负责培养方案设计、开题报告审核、毕业论文质量把关等工作。

## 六、学分要求与课程设置

### (1) 学分要求

金融专业硕士培养实行学分制，每 16 个学时为 1 学分。总学分不少于 41 学分，其中课程学分不少于 34 学分。

金融专业硕士课程学习一般安排在 1.5 学期内完成。

### (2) 课程设置

金融专业硕士课程分为公共必修课、专业基础课、方向必修课、选修课程四类。

#### ①公共必修课（6 学分）

专业硕士公共必修课包括《新时代中国特色社会主义理论与实践》（必修，2 学分）、《马克思主义与社会科学方法论》（必修，1 学分）、《英语》（必修，3 学分）。

#### ②专业基础课（12 学分）

专业基础课包括《金融理论与政策》（必修，3 学分）、《投资学》（必修，3 学分）、《财务报表分析》（必修，3 学分）、《公司金融》（必修，3 学分）。

#### ③方向必修课（4 学分）

方向必修课程包括《金融伦理》（必修，2 学分）、《金融工程

学》(必修, 2 学分)。

#### ④选修课程 (12 学分)

选修课程从下列课程中选择 6 门或 6 门以上的课程。《商业银行经营管理案例》(2 学分)、《财富管理》(2 学分)、《固定收益证券》(2 学分)、《企业并购与重组案例》(2 学分)、《私募股权投资》(2 学分)、《基金投资与管理》(2 学分)、《金融营销》(2 学分)、《证券投资技术分析》(2 学分)、《金融企业战略管理》(2 学分)、《金融法》(2 学分)、《行为金融学》(2 学分)、《金融史》(2 学分)、《金融监管》(2 学分)、《量化金融》(2 学分)、《区块链与智能金融》(2 学分)。

## 七、必修环节

必修环节是指课程学习之外的行业前沿讲座、文献研读、中期考核、专业实践等必须完成的培养环节, 不计学时。

### (1) 行业前沿讲座 (1 学分)

金融硕士专业每年都会邀请金融行业具有丰富实践经验的高级管理专家, 开设行业发展前沿讲座。金融专业硕士学生在学期间须参加 3 次以上的行业前沿讲座。

### (2) 文献研读 (1 学分)

金融专业硕士学生应完成本专业类别(领域)和导师指定的经典必读书目和重要学术期刊、文献专著的研读。导师负责对学生文献研读的指导、检查与考核, 可采用读书报告、专题研讨, 学生提交研读报告等方式进行。

### (3) 专业实践 (4 学分)

专业实践是指金融专业硕士采用集中实践和分段实践相结合的方式, 到金融企业开展实践活动, 是金融专业硕士培养中的重要环节。金融专业硕士专业实践的时间应不少于 3 个月。

专业实践结束后，金融专业硕士须填写《华南师范大学专业学位研究生实践考核表》，并提交不少于 5000 字的专业实践报告，专业实践考核合格后获得相应学分。

#### **(4) 中期考核 (1 学分)**

中期考核是保证研究生培养质量的重要环节。中期考核内容主要包括研究生思想政治表现、课程以及其他培养环节的完成情况、实践研究情况、身心状况等。中期考核通过者，方可进入论文写作阶段。

金融专业硕士中期考核时间安排在每年 9 月初举行，专业实践汇报、文献研读、论文开题报告都纳入中期考核。

金融专业硕士中期考核分组进行，每组组长由外校专家担任，考核组成员由三部分组成：外校专家、本校教师、行业专家。考核组成员不得包括考核学生导师。

金融专业硕士中期考核将对学生的专业实践报告进行评分，如果学生的毕业论文选题不是来自于专业实践，该生的专业实践成绩不能获得优秀等级的成绩。

金融专业硕士中期考核还将对学生的文献研读、论文开题报告进行评估，确定是否予以通过。

开题或中期考核后，毕业论文选题发生重大变动的，应重新开题。

### **八、毕业要求和标准**

金融专业硕士应修满规定的学分，中期考核合格，并通过论文答辩方可毕业。

### **九、学位论文**

金融专业硕士的论文选题要有现实针对性和应用性，具有明确的职业背景和应用价值，一般应与金融专业实践相结合。金融专业

硕士学位论文包括调研报告、金融产品设计、金融问题解决方案、案例分析、量化策略、行业研究报告等**6**种类型，每类论文都有明确的写作规范。

金融专业硕士开题后，要根据论文写作类型、论文选题和收集的写作素材及资料，在导师指导下，按照各类型的写作规范，结合开题过程中各委员提出的问题和思路，保质保量完成论文写作。

## 十、其他规定

本培养方案自**2021**级金融专业硕士研究生开始执行。

## 课程设置

类别	课程名称	学分	学时	开课学期	考核方式	备注
公共 必修课	新时代中国特色社会主义理论与实践 Theory and Practice of Socialism with Chinese Characteristics in the New Era	2	32	1	考试	必修
	马克思主义与社会科学方法论 Marxism and Social Science Methodology	1	16	1	考试	必修
	学术外国语 Academic Foreign Language	3	48	1	考试	必修
学科 基础课	金融理论与政策 Financial Theory and Policy	3	48	1	考试/ 考查	必修
	财务报表分析 Financial Statement Analysis	3	48	1	考试/ 考查	必修
	投资学 Investments	3	48	1	考试/ 考查	必修
	公司金融 Corporate Finance	3	48	1	考试/ 考查	必修
方向 必修课	金融伦理 Financial Ethics	2	32	1	考试/ 考查	必修
	金融工程学 Financial Engineering	2	32	1	考试/ 考查	必修
选修 课程 (不低 于12学 分)	商业银行经营管理案例 Bank Management Case	2	32	2	考查	选修
	金融监管 Financial Regulation	2	32	2	考查	选修
	固定收益证券 Fixed Income Securities	2	32	2	考查	选修
	量化金融 Quantitative Finance	2	32	2	考查	选修
	基金投资与管理 Fund Investment and Management	2	32	2	考查	选修
	财富管理 Wealth Management	2	32	2	考查	选修
	企业并购与重组案例 Corporate Mergers, Acquisition and Restructuring Case	2	32	2	考查	选修



	证券投资技术分析 Technical Analysis of Securities Investment	2	32	2	考查	选修
	区块链与智能金融 Blockchain and Intelligent Finance	2	32	2	考查	选修
	私募股权投资 Private Equity Investment	2	32	2	考查	选修
	金融法 Financial Law	2	32	2	考查	选修
	金融史 Financial History	2	32	2	考查	选修
	行为金融学 Behavior Finance	2	32	2	考查	选修
必修 环节	行业前沿讲座 Lectures on Industry Frontiers	1	/	/	考查	必修
	文献研读 Literature Study	1	/	/	考查	必修
	中期考核 Interim Evaluation	1	/	/	考查	必修
	专业实践 Professional Practice	4	/	/	考查	必修

## 研究生必读/选读书目及刊物

序号	著作或期刊名称	作者或出版社	文献类别	备注（选读/必读）
1	金融理论与政策	吴晓求、王广谦	教材	必读
2	货币金融学	米什金	教材	必读
3	金融市场与金融机构	李心丹	教材	必读
4	金融理论与公司政策	托马斯 E 科普兰	教材	必读
5	投资学	威廉·夏普	教材	必读
6	金融工程学	洛伦兹·格利兹	教材	必读
7	公司金融	朱叶	教材	必读
8	行为金融学	饶育蕾、盛虎	教材	必读
9	银行管理	蒂莫西·W. 科克	教材	必读
10	金融计量经济学导论	克里斯·布鲁克斯	教材	选读
11	衍生金融工具	王晋忠	教材	必读
12	固定收益证券定价与风险管理	姚长辉	教材	必读
13	金融监管学	郭田勇	教材	必读
14	财务报表分析	何青	教材	必读
15	企业并购与重组	上海国家会计学院	教材	选读
16	财富管理理论与实践	易行健	著作	必读
17	金融机构管理：一种风险管理方法	安东尼·桑德斯	著作	必读
18	风险管理与金融机构	约翰·赫尔	著作	必读
19	金融创新与市场的波动性	莫顿·米勒	著作	选读
20	私募股权投资管理	欧阳良宜	著作	必读

21	量化投资：策略与技术	丁鹏	著作	必读
22	互联网金融	罗明雄，唐颖，刘勇	著作	选读
23	世界金融史	(日)板谷敏彦	著作	必读
23	《金融伦理学》	(美)博特赖特	著作	必读
24	经济研究		期刊	选读
25	管理世界		期刊	选读
26	金融研究		期刊	选读
27	中国管理科学		期刊	选读
28	财经		期刊	选读
29	证券市场导报		期刊	选读
30	银行家		期刊	选读
31	中国货币市场		期刊	选读

**表格格式要求：**

**1.表头，宋体，五号，加粗；2.正文格式要求：宋体，五号，单倍行距；**

**3.表中全部字母、数字均为 Times New Roman。**

### 《财务报表分析》课程简明教学大纲

课程名称	财务报表分析			课程编号	0402e0002		
课程负责人	彭飞			课程负责人 所在单位	经济与管理学院		
教学团队成员	导师组						
课程类别	专业必修课	学时	54		学分	3	
授课方式及 时数分配	集中讲授	组织研讨	实验分析	读书指导	实地调研	自主学习	其他
课程定位、教学目的及要求、教学成效（请注明课程思政与国际化元素和方式）							
<p>该课程是教育部、全国金融硕士专业学位教育指导委员会规定的专业必修课程，也是金融硕士专业学科体系中的核心专业课程。本课程的学习目的是使学生能够全面深入地掌握财务报表分析的知识，具有较强的财务报表分析能力；能够根据用户的信息要求，结合实际情况，进行财务报表分析工作，毕业后能够很快适应财务报表分析工作的需要。教学的要求是通过本课程的教学，使学生达到：熟悉财务分析的基本概念，掌握财务报表分析的基本方法；能对资产负债表进行质量、趋势、结构分析；能对利润表进行质量、趋势、结构分析；能对</p>							

现金流量表进行质量、趋势、结构分析；掌握偿债能力分析的方法和步骤；掌握企业营运能力分析的方法和步骤；掌握企业盈利能力分析的方法和步骤；掌握企业发展能力分析的方法和步骤；掌握企业非会计报表信息的利用和分析；会对企业的财务进行综合分析和评价。	
教学内容及安排（请注明各章节及学时）	
第一章 财务报告与会计政策 第二章 财务报表分析方法 第三章 利润表分析 第四章 收入费用分析 第五章 资产负债表分析 第六章 流动资产分析 第七章 长期资产分析 第八章 负债分析 第九章 所有者权益分析 第十章 现金流量表分析 第十一章 投资报酬分析 第十二章 盈余管理与虚假财务报表识别	
考核方式	命题考试
使用教材	<input type="radio"/> 自编讲义 <input type="radio"/> 已出版的自编教材 <input checked="" type="radio"/> 其他公开出版教材 戴欣苗编著，《财务报表分析（技巧、策略）》，清华大学出版社；
参考书目	张先治、陈友邦编著，《财务分析》，东北财经大学出版社； 张行民编著，《企业财务报表分析》，对外经济贸易大学出版社； 李心合、赵华著，《会计报表分析》，中国人民大学出版社； 马贤明、郑朝辉著，《会计迷局》，大连出版社。

## 《公司金融》课程简明教学大纲

课程名称	公司金融		课程编号	0402e0003			
课程负责人	苏奇谋		课程负责人 所在单位	经济与管理学院			
教学团队成员	导师组						
课程类别	专业必修课	学时	54		学分	3	
授课方式及 时数分配	集中讲授	组织研讨	实验分析	读书指导	实地调研	自主学习	其他
课程定位、教学目的及要求、教学成效（请注明课程思政与国际化元素和方式）							
<p>公司金融是对公司财务理论和微观财务操作行为的学习和研究的课程。通过本课程的学习，一方面要求研究生理解和掌握公司财务的基本理论和方法；另一方面，要求研究生能熟练地运用公司财务理论模型去实证分析现实公司财务中的问题和检验公司政策效应，并能够应用理论解决公司财务中的实际问题。本课程的学习和研究重在培养研究生应用前沿的公司财务理论，解决公司财务运营中存在的实际问题的能力。</p>							
教学内容及安排（请注明各章节及学时）							
<p>Part I Value and Capital Budgeting                  Part II Capital Structure and Dividend Policy                  Part III Options, Futures, and Corporate Finance                  Part IV Special Topics</p>							
考核方式	课堂参与度（60%）+课程论文（40%）						
使用教材	<input type="radio"/> 自编讲义 <input type="checkbox"/> 已出版的自编教材 <input checked="" type="checkbox"/> 其他公开出版教材						
	Corporate finance, Stephen A Ross; Randolph Westerfield; Jeffrey F Jaffe, Boston, Mass. : McGraw-Hill/Irwin, 2013						
参考书目	Principles of Corporate Finance. Brealey, Richard; Myers, Stewart; Allen, Franklin, Irwin Professional Pub 2013. Corporate finance : principles and practice, Denzil Watson; Antony Head, Harlow, England ; New York : Pearson, 2013. Corporate finance : a practical approach, Michelle R Clayman; Martin S Fridson; George H Troughton; Hoboken, N. J. : Wiley, 2012. Corporate finance and investment : decisions and strategies, Richard Pike; Bill Neale; Philip Linsley, New York : Pearson Financial Times / Prentice Hall, 2012.						

## 《投资学》课程简明教学大纲

课程名称	投资学		课程编号	0402b0023			
课程负责人	屠新曙		课程负责人 所在单位	经济与管理学院			
教学团队成员	屠新曙						
课程类别	专业必修课	学时	54		学分	3	
授课方式及 时数分配	集中讲授	组织研讨	实验分析	读书指导	实地调研	自主学习	其他
课程定位、教学目的及要求、教学成效（请注明课程思政与国际化元素和方式）							
<p>掌握与金融投资有关的基本概念，基本理论；</p> <p>掌握金融资产定价的基本理论和方法；</p> <p>理解投资组合的基本原理和方法。</p>							
教学内容及安排（请注明各章节及学时）							
<p>第一章 证券与证券市场</p> <p>1.1 证券</p> <p>1.2 衍生证券</p> <p>1.3 证券市场</p> <p>1.4 证券交易所的证券交易过程</p> <p>1.5 证券的买卖</p> <p>1.6 证券投资过程</p> <p>第二章 证券的收益及其度量</p> <p>2.1 业绩表现</p> <p>2.2 单期收益率</p> <p>2.3 多期收益率</p> <p>2.4 对数收益率</p> <p>2.5 预期收益率</p> <p>第三章 证券的风险及其度量</p> <p>3.1 风险的来源与种类</p> <p>3.2 单个证券的风险度量</p> <p>3.3 证券组合效应</p> <p>3.4 证券组合的收益与预期收益</p> <p>3.5 协方差与相关系数</p> <p>3.6 证券组合的风险</p> <p>第四章 证券组合分析</p> <p>4.1 结合线</p> <p>4.2 寻找证券组合的最小方差集合</p> <p>4.3 寻找证券组合的有效集</p>							

第五章 无风险借贷	
5.1 无风险资产的定义	
5.2 无风险资产的贷出	
5.3 无风险资产的借入	
5.4 允许同时进行无风险资产的借贷	
5.5 不同借贷利率下证券组合的有效前沿	
第六章 证券组合的效用最大化	
6.1 无差异曲线 (IDC)	
6.2 效用最大化的风险投资组合	
6.3 无风险借贷下证券组合的效用最大化	
6.4 不同借贷利率下证券组合的效用最大化	
第七章 资本资产定价模型	
7.1 资本资产定价模型的假设	
7.2 资本市场线	
7.3 证券市场线	
7.4 风险分解	
第八章 套利定价理论	
8.1 单因素模型	
8.2 多因素模型	
8.3 套利定价理论的假设	
8.4 套利与套利组合	
8.5 单因素套利定价理论	
8.6 多因素套利定价理论	
第九章 证券组合投资业绩评价	
9.1 证券投资业绩评价的意义	
9.2 证券投资业绩评价中的数量统计方法	
9.3 证券投资业绩评价模型	
9.4 基于单因素模型业绩评价方法的案例分析	
9.5 经典 Jensen 指数绩效评价方法的实证分析	
考核方式	命题考试
使用教材	<input type="radio"/> 自编讲义 <input type="radio"/> 已出版的自编教材 <input checked="" type="radio"/> 其他公开出版教材
	威廉·夏普, 投资学 (第 8 版·上), 中国人民大学出版社, 2011. 6
参考书目	罗伯特·豪根, 现代投资理论, 北京大学出版社, 2005. 3 兹维·博迪, 投资学 (第 9 版), 机械工业出版社, 2012. 8

## 《金融理论与政策》课程简明教学大纲

课程名称	金融理论与政策			课程编号	0402e0001		
课程负责人	张勇			课程负责人 所在单位	经济与管理学院		
教学团队成员	张勇						
课程类别	专业必修课		学时	54		学分	3
授课方式及 时数分配	集中讲授	组织研讨	实验分析	读书指导	实地调研	自主学习	其他
课程定位、教学目的及要求、教学成效（请注明课程思政与国际化元素和方式）							
<p>通过本课程的学习,使得学生深刻掌握金融学的基本理论、研究方法和政策实践,能够运用相关理论和方法分析现实中的金融问题,理解各种金融政策的理论基础,评估其实施效果。</p>							
教学内容及安排（请注明各章节及学时）							
第一章 货币与货币制度 第二章 信用与金融 第三章 金融功能与金融结构 第四章 利率期限结构理论 第五章 资产定价理论 第六章 行为金融理论 第八章 货币供求及其均衡理论 第九章 中央银行与货币政策传导机制理论 第十章 汇率决定与汇率制度选择 第十一章 开放经济条件下汇率政策 第十二章 金融风险与金融危机理论 第十三章 金融监管理论							
考核方式	命题考试 课程论文						
使用教材	<input type="radio"/> 自编讲义 <input checked="" type="radio"/> 已出版的自编教材 <input type="radio"/> 其他公开出版教材						
	凌江怀主编：《金融学概论》，高等教育出版社，2014，第三版。						
参考书目	吴晓求、王广谦主编：《金融理论与政策》，中国人民大学出版社，2013年。 米什金：《货币金融学》，中国人民大学出版社，2011年。 饶育蕾、盛虎：《行为金融学》，机械工业出版社，2015年。						



## 《金融伦理学》课程简明教学大纲

课程名称	金融伦理学			课程编号			
课程负责人	曾庆鹏			课程负责人 所在单位		经济与管理学院	
教学团队成员	曾庆鹏						
课程类别	选修课程		学时	36		学分	2
授课方式及 时数分配	集中讲授	组织研讨	实验分析	读书指导	实地调研	自主学习	其他
课程定位、教学目的及要求、教学成效（请注明课程思政与国际化元素和方式）							
<p>通过课程学习，使学生初步理解金融伦理在金融体系中的重要性，从而将伦理原则贯彻到未来的职业生涯中；金融伦理问题的探讨、研究和学习有利于挖掘传统金融学教育的新维度。</p>							
教学内容及安排（请注明各章节及学时）							
<p>第一章，金融伦理学概论</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1. 经济学、金融学中的价值判断与伦理考虑</li> <li>2. 金融伦理学的必要性</li> <li>3. 金融伦理学的研究领域</li> </ol> <p>第二章，金融伦理学的理论体系</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1. 金融伦理学基本范畴和分析框架</li> <li>2. 金融伦理学的基本原理</li> </ol> <p>第三章，商业银行的伦理问题</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1. 商业银行经营管理的伦理原则</li> <li>2. 商业银行信贷的公平与效率</li> <li>3. 银行零售业务伦理</li> </ol> <p>第四章，投资银行与保险机构的金融伦理问题</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1. 投资银行的经营模式与行为规范</li> <li>2. 共同基金与投资伦理</li> <li>3. 保险业的运作机制与伦理问题</li> </ol> <p>第五章，金融市场中的伦理问题</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1. 金融市场结构与伦理行为规范</li> <li>2. 上市公司、评级机构及金融市场交易的伦理问题</li> </ol> <p>第六章，民间金融的伦理问题</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1. 民间金融的运作模式及伦理支撑</li> <li>2. 民间金融的伦理危机</li> </ol> <p>第七章，金融危机、金融监管与金融伦理</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1. 金融体系与金融危机的传导</li> <li>2. 金融监管腐败与自由主义监管伦理的转向</li> </ol>							

<p>3. 金融创新金融科技浪潮中的伦理关系的发展</p> <p>第八章，国际金融中金融伦理思考</p> <p>1. 美元本位与国际货币体系演变</p> <p>2. 华盛顿共识与美式金融资本的现实和伦理困境</p> <p>3. 制造业和产业资本的国际需求与人民币国际化可能的路径。</p>	
考核方式	考勤与课堂讨论演示作为平时成绩（40%），期末（60%）以闭卷或开卷（待定）的形式进行。
使用教材	<input type="radio"/> 自编讲义 <input type="radio"/> 已出版的自编教材 <input checked="" type="radio"/> 其他公开出版教材 《金融伦理学》（美）博特赖特 北京大学出版社.
参考书目	《金融伦理学》王曙光等 北京大学出版社 《现代金融的伦理维度》丁瑞莲 人民出版社 《金融的逻辑》陈志武 国际文化出版公司

## 《金融工程学》课程简明教学大纲

课程名称	金融工程学			课程编号	0402f0004		
课程负责人	李庆峰			课程负责人 所在单位	经济与管理学院		
教学团队成员	李庆峰						
课程类别	选修课程		学时	36		学分	2
授课方式及 时数分配	集中讲授	组织研讨	实验分析	读书指导	实地调研	自主学习	其他
课程定位、教学目的及要求、教学成效（请注明课程思政与国际化元素和方式）							
<p>1、了解金融工程的学科地位和前沿发展动态；</p> <p>2、掌握金融工程的无套利定价原理理论框架；</p> <p>3、掌握金融风险管理的主要理论和方法；</p> <p>4、掌握远期合约、期货、期权、互换四大基础衍生工具的定价原理和方法；</p> <p>5、结合国内外实践的案例分析与讨论，提高学生的实践工作能力和业务能力。</p>							
教学内容及安排（请注明各章节及学时）							
<p>第一课，《现代主流金融学的发展历史回顾及研究前沿》，理论授课+讨论。教学目标和要求：了解现代金融学的发展脉络和方法论演变；了解金融工程在学科体系中的地位、学科特点及发展动态。</p> <p>第二课，《无套利定价原理及其应用专题（上）》，理论授课。教学目标和要求：理解与掌握无套利定价原理的 Arrow-Debreu 模型；理解与掌握 Arrow-Debreu 模型的经济含义；初步掌握模型的简单应用。</p> <p>第三课，《无套利定价原理及其应用专题（下）》，讨论交流课。教学目标和要求：围绕封闭式基金折价和定向增发定价问题，组织研究生进行文献阅读讨论，通过课堂交流分析，思考比较中外同一个问题的方法论差异，探讨金融工程“无套利定价”原理的灵活应用，提高研究生的选题、文献阅读和综合应用能力。</p> <p>第四课，《金融风险管理原理专题》，理论授课+讨论。教学目标和要求：理解与掌握金融风险的度量的几种主要方法；掌握 VAR 方法的原理，了解主要计算方法；理解信用风险管理的几种主要方法之间的区别；案例应用与讨论。</p> <p>第五课，《固定收益证券专题》，理论授课+讨论。教学目标和要求：理解与掌握现金流贴现定价原理；理解与掌握债券久期与凸度的概念、公式与应用；理解与掌握利率免疫的原理与方法；案例应用与讨论。</p> <p>第六课，《金融期货定价专题》。教学目标和要求：理解与掌握金融期货与商品期货定价的不</p>							

同；学会利用无套利定价原理为外汇期货、股指期货、利率期货进行定价；案例应用与讨论。	
第七课，《金融期权定价专题》。教学目标和要求：理解金融期货与期权在权利与义务对称性方面的本质不同；理解与掌握期权定价的二叉树方法和 Black-Scholes 方法；理解与掌握期权平价定理；案例应用与讨论。	
第八课，《互换专题》。教学目标和要求：理解互换产生的相对优势及互换过程中的利益分配；掌握利用无套利定价原理为利率互换进行定价；理解与掌握利率互换和货币互换定价问题的异同；案例应用与讨论。	
第九课，讨论交流课。教学目标和要求：回顾总结学期授课内容，答疑同时理论联系实际，和学生就现实金融热点问题进行交流讨论，开阔研究生视野，布置课程论文。	
考核方式	课程论文
使用教材	<input type="radio"/> 自编讲义 <input type="radio"/> 已出版的自编教材 <input checked="" type="radio"/> 其他公开出版教材 《金融工程》，吴冲锋等编著，高等教育出版社
参考书目	《中级金融工程学》，周洛华著，上海财大出版社 《期货、期权和其他衍生品》，（加）约翰·赫尔（John C. Hull），清华大学出版社 《金融创新》，菲利普·莫利纽克斯，尼达尔·莎姆洛克，中国人民大学出版社 《金融工程》，（林清泉主编），中国人民大学出版社 《金融工程学》，（郑振龙著），高等教育出版社 《金融经济学》，（布莱恩·克特尔），中国金融出版社 《金融经济学》，（王江），中国人民大学出版社 《金融工程学》，（王安兴编著），上海财经大学出版社

## 《商业银行经营管理》课程简明教学大纲

课程名称	商业银行经营管理			课程编号	0402f0001		
课程负责人	陈高翔			课程负责人 所在单位	经济与管理学院		
教学团队成员	陈高翔						
课程类别	选修课程		学时	36		学分	2
授课方式及 时数分配	集中讲授	组织研讨	实验分析	读书指导	实地调研	自主学习	其他
课程定位、教学目的及要求、教学成效（请注明课程思政与国际化元素和方式）							
<p>通过本课程的学习，使学生熟悉各国银行制度，特别是商业银行制度，掌握商业银行经营管理的基本概念和基本理论、商业银行业务运营状况及业务操作技能、商业银行不同管理理念和不同经营模式、国际商业银行的业务创新及经营管理的发展趋势、我国商业银行经营管理存在的问题及未来发展方向。</p>							
教学内容及安排（请注明各章节及学时）							
<p>第一章 商业银行概述            第二章 商业银行管理目标及范围            第三章 商业银行经营            第四章 商业银行财务分析与管理            第五章 商业银行资本管理            第六章 商业银行负债管理            第七章 商业银行资产管理            第八章 商业银行资产负债综合管理            第九章 商业银行表外业务的发展与管理            第十章 商业银行国际业务管理            第十一章 商业银行组织管理和人力资源管理            第十二章 商业银行创新            第十三章 商业银行兼并与收购</p>							
考核方式	命题考试、课程论文						
使用教材	<input type="radio"/> 自编讲义 <input checked="" type="radio"/> 已出版的自编教材 <input type="radio"/> 其他公开出版教材						
	凌江怀主编：《现代商业银行经营与管理》，广东旅游出版社 2000。						
参考书目	凌江怀著：《商业银行风险论》，人民出版社，2006。 凌江怀主编：《金融学概论》，高等教育出版社，2010。 唐旭，戴小平著：《商业银行经营管理》，西南财经大学出版社，2000。 戴国强主编：《商业银行经营学》，上海财经大学出版社，2004。 刘金波主编：《银行经营管理》，中国金融出版社，2012。 任远主编：《商业银行经营管理学》（第二版），科学出版社，2012。 刘忠燕主编：《商业银行经营管理学案例》，中国金融出版社，2004。 Rose, P.S:《Bank Management & Financial Services》，The McGraw-Hill Companies Inc, 2005.						

## 《金融监管》课程简明教学大纲

课程名称	金融监管		课程编号	0402f0002			
课程负责人	吴超林		课程负责人 所在单位	经济与管理学院			
教学团队成员	吴超林、彭连清						
课程类别	选修课程	学时	36		学分	2	
授课方式及 时数分配	集中讲授	组织研讨	实验分析	读书指导	实地调研	自主学习	其他
课程定位、教学目的及要求、教学成效（请注明课程思政与国际化元素和方式）							
<p>通过本课程的学习, 可以使学生掌握金融监管的基本理论和方法, 了解金融监管与金融稳定的关系; 熟悉金融监管体系运作和金融监管实务, 牢固对立对金融法律法规的敬畏观念; 了解金融监管历史演变和前沿发展, 并能运用金融监管理论和方法解释和分析社会经济现象, 研究经济金融问题。</p>							
教学内容及安排（请注明各章节及学时）							
<p>导论金融监管的产生、发展与最新趋势            第一篇金融监管与金融发展            第一章金融监管与金融稳定            第二章金融监管与金融创新            第二篇金融监管理论            第三章金融监管概述            第四章金融监管理论            第三篇金融监管体系分析            第五章金融监管体制概述            第六章金融机构内部控制制度            第七章行业自律和市场约束            第四篇金融监管实务            第九章银行业监管            第十章证券业监管            第十一章保险业监管            第十二章对其他金融的监管            第五篇金融监管的协调与合作</p>							
考核方式	命题考试 课程论文						
使用教材	<input type="radio"/> 自编讲义 <input type="radio"/> 已出版的自编教材 <input checked="" type="radio"/> 其他公开出版教材 金融监管, 哈威尔·E·杰克逊, 小爱德华·L·西蒙斯编著吴志攀等译, 中国						

	政法大学出版社，2003；
参考书目	<p>金融监管教程，郭田勇主编，中国金融出版社，2005；</p> <p>金融监管典型案例教程，丁建臣，付东升，朗俊义主编，对外经济贸易大学出版社，2008；</p> <p>金融监管学，主编祁敬宇，西安交通大学出版社，2013；</p> <p>中国金融监管报告，主编胡滨，社会科学文献出版社，2012；</p> <p>金融监管案例，主编李成，西安交通大学出版社，2011；</p> <p>金融监管案例评析，祁敬宇、祁绍斌主编，首都经济贸易大学出版社，2011；</p> <p>迷途难返：货币政策与金融监管新走向，钟伟、谢婷著，中国经济出版社，2011。</p>

## 《固定收益证券》课程简明教学大纲

课程名称	固定收益证券			课程编号			
课程负责人	张鹏			课程负责人 所在单位		经济与管理学院	
教学团队成员	导师组						
课程类别	选修课		学时	36		学分	2
授课方式及 时数分配	集中讲授	组织研讨	实验分析	读书指导	实地调研	自主学习	其他
<p>课程定位、教学目的及要求、教学成效（请注明课程思政与国际化元素和方式）</p> <p>《固定收益证券》是金融学专业中的一门重要课程。通过本课程的学习，使学生理解固定收益债券定价的基本知识。本课程运用国际前沿金融理论与金融分析技术，探讨中国债券市场的估值与价格计算问题。本课程以中国债券市场作为债券估值与定价的分析背景，不但介绍了相关的金融理论与利率模型，还探讨了它们在中国的应用以及存在的问题，绝大多数案例与算例都采用中国债券市场的债券品种与真实的交易数据。</p>							
<p>教学内容及安排（请注明各章节及学时）</p> <p>第一章 固定收益证券概述</p> <p>第二章 到期收益率与总收益分析</p> <p>第三章 零息债券与付息债券</p> <p>第四章 持续期与凸性</p> <p>第五章 利率互换</p> <p>第六章 利率远期、期货与回购协议</p> <p>第七章 含权债券的定价</p>							
考核方式	命题考试						
使用教材	<input type="radio"/> 自编讲义 <input type="radio"/> 已出版的自编教材 <input type="radio"/> 其他公开出版教材						
	姚长辉《固定收益证券定价与风险管理》（第3版）北京大学出版社，2019年12月；						
参考书目	1.陈蓉,郑振龙《固定收益证券》,机械工业出版社,2011年9月。 2.布鲁斯·塔克曼,固定收益证券,机械工业出版社,2013.12 3.弗兰克·J·法博齐,固定收益证券手册,中国人民大学出版社,2014.2 4.李磊宁《固定收益证券的估值、定价与计算》,北京师范大学出版社,2011年1月.						



## 《量化金融学》课程简明教学大纲

课程名称	量化金融学			课程编号	0402f0042		
课程负责人	苏奇谋			课程负责人 所在单位	经济与管理学院		
教学团队成员	苏奇谋						
课程类别	选修课程		学时	36		学分	2
授课方式及 时数分配	集中讲授	组织研讨	实验分析	读书指导	实地调研	自主学习	其他
课程定位、教学目的及要求、教学成效（请注明课程思政与国际化元素和方式）							
<p>本课程主要介绍量化金融学的基本概念、方法与模型，结合国内外量化投资实践经验，为学生从事量化金融行业打下良好的基础。通过本课程的学习，使学生了解量化金融学科特点与发展动态，理解完备市场资产定价的基本理论框架，熟悉债券、远期、期货、互换等利率衍生品的基本知识与市场惯例，掌握理解利率顶、利率底、互换期权等利率期权的基本特征和定价方法，理解利率期限结构的建模原理及基本利率模型的特征与应用，理解利率风险管理的基本原理与方法。本课程注重培养学生在量化金融方面的直觉思维能力，以及应用有效的方法解决实际问题的能力。</p>							
教学内容及安排（请注明各章节及学时）							
<p>第一课、量化金融概述与预备知识 了解现代金融学的学科特点和发展动态；理解利率、复利、零息债券等金融学基本概念；掌握现金流贴现估值原理；熟悉债券市场惯例、利率衍生品的风险特征与市场概况。</p> <p>第二课、利率远期、利率期货与利率互换 理解远期利率协议、远期利率、同行拆借利率和收益率曲线等基本概念及其作用；理解利率期货和利率互换的基本定价原理；掌握债券久期与凸度的概念、公式及应用。</p> <p>第三课、期权与无套利定价基本原理 掌握期权基本概念、期权平价定理及期权价格界限；理解套利概念、无套利假设及无套利定价的基本原理与应用；了解常用期权套保策略和期权交易策略。</p> <p>第四课、完备市场资产定价基本定理 理解完备市场资产定价基本定理；掌握风险中性定价及二叉树估值方法；了解风险中性测度变换的原理、等价鞅测度的概念及其在数学上和金融上的理解。</p> <p>第五课、BSM 定价模型与风险对冲 理解 BSM 模型的基本原理、推导及应用；理解隐含波动率的概念、估算方法与实际意义；掌握常用希腊字母（价格敏感度）的计算方法，及其在量化交易与风险对冲实践中的应用。</p> <p>第六课、利率期限结构模型 熟悉利率波动的典型特征、利率收益曲线的形状与动态变化情况；理解利率期限结构的因子分析模型和无套利拟合方法；了解传统利率期限结构模型理论的基本特征与优缺点。</p> <p>第七课、利率期权与定价原理 理解封顶期权、封底期权、互换期权等利率期权的基本特征与作用；初步理解债券期权、可</p>							

<p>赎回债券、可转债等含权债的基本特征与定价方法；了解常见瞬时利率模型的基本特征与优缺点。</p> <p>第八课、BGM 市场模型</p> <p>理解 Black 模型及隐含波动率相关概念；理解 BGM LIBOR 市场模型基本框架及相关波动率曲面模型；了解可取消互换和可赎回互换期权等常见金融产品的基本特征与定价方法。</p> <p>第九课、利率风险管理</p> <p>掌握期权调整利差分析法；理解利率风险在险值（VAR）的基本原理与计算方法；理解参数解析法与蒙特卡洛仿真等方法的基本原理、应用与优缺点。</p>	
考核方式	平时成绩（30%） + 闭卷考试（70%）
使用教材	<input type="radio"/> 自编讲义 <input type="radio"/> 已出版的自编教材 <input checked="" type="radio"/> 其他公开出版教材 《数量金融》（第 1 卷 原书第 2 版），[英] 保罗·威尔莫特著，郑振龙等译，机械工业出版社，2015
参考书目	《固定收益证券》，陈蓉、郑振龙主编，北京大学出版社，2011 《金融方程式：数量金融的应用与未来》，[英] 保罗·威尔莫特，机械工业出版社，2018 《宽客人生：从物理学家到数量金融大师的传奇》，[美] 伊曼纽尔·德曼著，韩冰洁等译，机械工业出版社，2015

## 《基金投资与管理》课程简明教学大纲

课程名称	基金投资与管理			课程编号	0402f0005		
课程负责人	彭文平			课程负责人 所在单位	经济与管理学院		
教学团队成员	彭文平						
课程类别	选修课程		学时	36		学分	2
授课方式及 时数分配	集中讲授	组织研讨	实验分析	读书指导	实地调研	自主学习	其他
课程定位、教学目的及要求、教学成效（请注明课程思政与国际化元素和方式）							
<p>掌握与证券投资基金有关的基本概念，基本理论；</p> <p>掌握证券投资基金投资的基本理论和方法；</p> <p>理解证券投资基金管理的基本原理和方法。</p>							
教学内容及安排（请注明各章节及学时）							
<p>第1篇 基金市场</p> <p>第1章 投资基金简介与发展历史</p> <p>1.1 什么是投资基金</p> <p>1.2 投资基金的优势与局限</p> <p>1.3 投资基金在金融市场的角色</p> <p>1.4 投资基金的发展简史</p> <p>1.5 我国证券投资基金业发展历程</p> <p>第2章 基金的基本分类</p> <p>2.1 合同型基金与公司型基金</p> <p>2.2 开放式基金与封闭式基金</p> <p>2.3 股票基金、债券基金和混合型基金</p> <p>2.4 货币市场基金</p> <p>2.5 成长型基金、收入型基金、平衡型基金和价值型基金</p> <p>2.6 国内基金、国际基金、离岸基金和海外基金</p> <p>2.7 公募基金与私募基金</p> <p>第3章 基金特殊品种</p> <p>3.1 指数基金</p> <p>3.2 交易型开放式指数基金(ETF)</p> <p>3.3 伞型结构基金</p> <p>3.4 保本基金</p> <p>3.5 生命周期基金</p> <p>3.6 量化投资基金</p> <p>3.7 社会责任基金和公司治理基金</p> <p>3.8 境内募集海外投资基金——QDII 基金</p> <p>3.9 基金的基金</p> <p>3.10 分级基金</p> <p>第2篇 基金交易</p> <p>第4章 基金的资产净值与估值</p>							

- 4.1 资产净值
- 4.2 基金资产估值
- 4.3 基金估值中存在的问题
- 第5章 基金的交易
  - 5.1 开放式基金报价
  - 5.2 认购、申购与赎回
  - 5.3 基金转换、非交易过户、转托管与份额冻结
  - 5.4 开放式基金特殊交易的处理
  - 5.5 自动投资计划
- 第6章 基金费用
  - 6.1 基金持有人费用
  - 6.2 基金的运营费用
  - 6.3 基金费率的灵活设计
  - 6.4 美国的基金费率
  - 6.5 我国基金管理费制度的创新
  - 6.6 我国基金管理费的问题与改革
- 第7章 基金的注册登记、过户清算与营销
  - 7.1 基金的注册登记
  - 7.2 基金的过户清算
  - 7.3 我国开放式基金注册登记、过户及清算方式的发展趋势
  - 7.4 基金营销方式
  - 7.5 开放式基金营销方式的国际比较
  - 7.6 我国证券投资基金营销的现状
- 第3篇 基金管理
- 第8章 基金募集设立
  - 8.1 基金募集程序
  - 8.2 基金合同
  - 8.3 招募说明书
  - 8.4 基金的募集与认购
- 第9章 基金管理(1): 投资决策过程与策略
  - 9.1 基金的投资决策程序
  - 9.2 基金的投资目标和投资理念
  - 9.3 基金的投资策略
- 第10章 基金管理(2): 资产配置与投资风格
  - 10.1 资产配置定义
  - 10.2 资产配置的步骤与基本方法
  - 10.3 资产配置策略的主要类型及比较
  - 10.4 资产配置、行业配置、个股选择的实际案例分析
  - 10.5 我国基金的投资组合
  - 10.6 基金的投资风格
- 第11章 基金管理(3): 流动性管理与投资限制
  - 11.1 开放式基金的流动性风险
  - 11.2 国外开放式基金的流动性管理

11.3	我国开放式基金的流动性管理
11.4	开放式基金的融资管理
11.5	基金投资的限制
11.6	基金投资的特殊问题
第12章	基金管理(4): 基金的收益分配与税收
12.1	基金的收益来源和基金收益概念
12.2	基金收益的分配方案
12.3	基金的收益分配
12.4	基金的税收
第13章	基金管理(5): 基金信息披露
13.1	国外基金的信息披露要求
13.2	我国基金的信息披露要求
13.3	基金信息披露的内容和格式
13.4	基金信息披露中的问题
第14章	基金管理(6): 理论与实务
14.1	证券组合管理理论及其应用
14.2	有效市场理论及其运用
14.3	博弈论与基金投资
14.4	行为金融理论与基金投资
第4篇	基金治理与绩效
第15章	基金治理结构(1): 背景与现实问题
15.1	基金治理结构定义
15.2	代理人成本与非对称信息
15.3	基金行业的道德风险
15.4	基金管理公司道德风险的解决对策
第16章	基金治理结构(3): 监管制度
16.1	基金监管: 定义与模式
16.2	基金监管机构与监管内容
16.3	基金监管的发展趋势
第17章	基金绩效评估
17.1	基金的财务分析
17.2	基金绩效评价指标
17.3	基金业绩评价指标的发展
17.4	基金绩效贡献的因素分析
17.5	基金的择时能力与选股能力评估方法和模型
17.6	基金绩效评级体系
17.7	基金选择指标
考核方式	考查
使用教材	<input checked="" type="radio"/> 自编讲义 <input type="radio"/> 已出版的自编教材 <input checked="" type="radio"/> 其他公开出版教材 王鲁志:《证券投资基金实务教程》, 复旦大学出版社, 2011 版
参考书目	中国证券业协会:《证券投资基金》, 中国金融出版社, 2012 版 李曜, 游韬嘉:《证券投资基金学》清华大学出版社, 2014 版

## 《财富管理》课程简明教学大纲

课程名称	财富管理			课程编号			
课程负责人				课程负责人 所在单位		经济与管理学院	
教学团队成员							
课程类别	选修课程		学时	36		学分	2
授课方式及 时数分配	集中讲授	组织研讨	实验分析	读书指导	实地调研	自主学习	其他
<p>课程定位、教学目的及要求、教学成效（请注明课程思政与国际化元素和方式）</p> <p>本课程教学的目的是让参与课程学习的高年级本科生或研究生了解整个财富管理行业的发展历史、现状和未来趋势；理解财富管理机构体系、财富管理的产品与服务体系；掌握基于居民家庭整个生命周期财富管理所需要的综合理论知识与应用分析方法，培养针对具体客户或居民家庭进行财富管理规划的能力；同时对最新的财富科技等有初步的了解。</p> <p>为学生未来在私人银行、商业银行财富管理或私人银行部与理财管理子公司、投资银行（或证券公司）财富管理部、保险公司与信托公司财富管理部门以及基金公司、第三方财富管理机构、家族办公室、与财富管理相关的金融科技从事理财规划、投资咨询、投资顾问、金融产品设计与营销等相关工作奠定坚实基础。</p>							
<p>教学内容及安排（请注明各章节及学时）</p> <p>第1章 财富管理概论（3-4个学时）</p> <p>（1）家庭财富统计口径、财富管理定义以及与资产管理区别与联系；</p> <p>（2）财富管理行业发展历史与推动因素；</p> <p>（3）财富管理的理论根源。</p> <p>第2章 财富管理流程（3个学时）</p> <p>（1）财富管理客户的分类标准和客户类型；</p> <p>（2）财富管理客户财务与非财务信息搜集；</p> <p>（3）财富管理客户财务分析；</p> <p>（4）财富管理方案的制定、执行与后续服务。</p> <p>第3章 财富管理体系（3个学时）</p> <p>（1）财富管理机构体系与类别；</p> <p>（2）财富管理产品体系与类别；</p> <p>（3）财富管理服务体系与类别；</p> <p>（4）财富管理监管体系。</p> <p>第4章 财富管理中的金融经济学基础（2-4个学时）</p> <p>（1）经典投资学模型；</p> <p>（2）有效市场假说及其对投资决策的影响；</p> <p>（3）行为金融理论概述；</p> <p>（4）财富管理中的行为偏差及其应用。</p> <p>第5章 财富管理中的生命周期消费储蓄理论（3-4个学时）</p>							

- (1) 绝对收入假说与消费函数之谜；
- (2) 持久收入-生命周期消费储蓄理论；
- (3) 预防性储蓄与流动性约束；
- (4) 考虑生育行为与遗产馈赠行为的家庭消费储蓄模型。

第 6 章 家庭生命周期资产配置理论（3-4 个学时）

- (1) 家庭风险金融资产投资基准模型与“股票市场有限参与之谜”；
- (2) “马尔基尔经验法则”与不确定性条件下家庭生命周期资产配置模型；
- (3) 考虑商业保险购买的家庭生命周期资产配置模型

第 7 章 家庭现金与负债管理（2-3 个学时）

- (1) 家庭现金负债管理的功能及其发展；
- (2) 家庭现金管理规划与现金收支表编制；
- (2) 家庭负债管理规划；
- (3) 个人信用评估方法与管理。

第 8 章 家庭房地产投资规划（3-4 个学时）

- (1) 房地产资产特点及其与金融资产的异同；
- (2) 自住型和投资型房地产资产投资规划；
- (3) 房地产金融资产的特征及其投资规划。

第 9 章 居民家庭保险规划（2-4 个学时）

- (1) 家庭风险管理的程序和保险的功能；
- (2) 商业保险的分类和功能；
- (3) 商业保险的分类和功能；
- (4) 家庭保险规划程序与组织实施。

第 10 章 家庭退休与养老金规划（2-4 个学时）

- (1) 退休养老规划流程与财务分析方法；
- (2) 退休与养老需求测算；
- (3) 养老金规划及其主要内容；
- (4) 养老金金融市场与养老金金融产品。

第 11 章 家庭财富保全与传承规划（2-4 个学时）

- (1) 财产属性及其风险以及财富保全流程；
- (2) 财富保全规划的工具、方法和程序；
- (3) 财富传承规划的工具、方法和程序。

第 12 章 税收筹划与财富管理（2-4 个学时）

- (1) 税收策划及其在财富管理中的作用；
- (2) 税收筹划策略；
- (3) 税收策划基本方法；
- (4) 非常规收入的税收筹划。

第 13 章 财富科技（2-3 个学时）

- (1) 财富科技的发展历程与驱动因素；
- (2) 财富管理链条上的新技术应用；
- (3) 智能投顾的起源、发展和流程及其监管。

考核方式	开卷考试（平时成绩 60%+期末成绩 40%）
使用教材	<input checked="" type="radio"/> 自编讲义 <input type="radio"/> 已出版的自编教材 <input type="radio"/> 其他公开出版教材

	(请注明使用教材名称、作者/主编、出版单位、出版年份、版次) 《财富管理理论与实践》，易行健主编，机械工业出版社，2021. 3。
参考书目	《私人财富管理(实践篇)》，史蒂芬 M. 霍兰(美)，机械工业出版社，2015. 11。



## 《企业并购与重组案例》课程简明教学大纲

课程名称	企业并购与重组案例			课程编号	0402F0007		
课程负责人	彭飞			课程负责人 所在单位	经济与管理学院		
教学团队成员	导师组						
课程类别	选修课程		学时	36		学分	2
授课方式及 时数分配	集中讲授	组织研讨	实验分析	读书指导	实地调研	自主学习	其他
课程定位、教学目的及要求、教学成效（请注明课程思政与国际化元素和方式）							
<p>企业并购重组是现代公司金融学的一大重要分支。它是以现实的企业资本运营（改制、上市、扩张、收缩等）需求为出发点，动态地研究企业在资本市场中的各种并购重组行为，从融资、价值评估、战略、绩效等多方面探讨公司并购的动因、运作机制和效果。通过《公司并购与重组》这门课程的学习，使学生掌握公司并购重组的原理和方法，了解美国等西方企业并购重组的历次浪潮的原因，我国企业并购重组的原因和特点，能用专业知识研究、分析企业并购重组案例，达到可以进行策划企业并购重组财务顾问工作的水平，成为投资银行或公司金融领域的管理者和从业人员。</p>							
教学内容及安排（请注明各章节及学时）							
<p>1、公司概念，公司法与现代公司，公司并购概念、分类；西方并购历史；中国企业并购历史讲授、讨论；公司并购的动因理论（效率、协同、内部化等）；公司并购的程序与中介机构的作用；</p> <p>2、目标公司的价值评估——现金流量折现等各种折现模型；市盈率，EV/EBITDA 等比率模型；-吸收合并中的换股比例决定；实物期权模型等高科技公司估值</p> <p>3、要约收购（TENDER OFFER）及案例</p> <p>4、杠杆收购，管理层收购 与 PE 投资案例</p> <p>5、ESOP 与股权激励案例</p> <p>6、并购融资手段</p> <p>7、公司反收购措施</p> <p>8、公司重组一：公司重整制度、股票回购、分立、缩股等案例</p> <p>9、公司重组二：整体上市，和解与破产案例</p> <p>10、公司并购重组的绩效</p>							
考核方式	考查						
使用教材	<input type="radio"/> 自编讲义 <input type="radio"/> 已出版的自编教材 <input checked="" type="radio"/> 其他公开出版教材						
	[美]J. 威斯通等，《接管、重组与公司治理》（第4版），北京大学出版社						

<p>参考书目</p>	<p>[美]高根 (Gaughan, P. A.) 著,《兼并、收购与公司重组》(第3版),机械工业出版社;</p> <p>王东、张秋生编著,《企业兼并与收购案例》,清华大学出版社;</p> <p>朱宝宪,《公司并购与重组》,清华大学出版社;</p> <p>李曜,《公司并购与重组导论》,上海财经大学出版社;</p> <p>其他参考资料:</p> <p>《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、中国企业并购网、各类财经资讯等。要求学生在校期间利用 WIND 数据库进行相关资料收集和分析。</p> <p>饶育蕾、盛虎:《行为金融学》,机械工业出版社,2015年。</p>
-------------	--

## 《区块链与智能金融》课程简明教学大纲

课程名称	区块链与智能金融			课程编号	0402f0040		
课程负责人	武艳杰			课程负责人 所在单位	经济与管理学院		
教学团队成员	武艳杰						
课程类别	选修课程		学时	36		学分	2
授课方式及 时数分配	集中讲授	组织研讨	实验分析	读书指导	实地调研	自主学习	其他
<p>课程定位、教学目的及要求、教学成效（请注明课程思政与国际化元素和方式）</p> <p>《区块链与智能金融》是对区块链技术及其对经济领域所引发的新现象、新问题进行探讨和学习的课程。通过本课程的学习，一方面要求金融专业研究生理解和掌握区块链经济的基本理论与相关行业运用及发展概况；另一方面，要求研究生能够理论结合实践，对区块链发展模式问题，通过理论学习和案例分析研究其运营原理与发展前景。</p> <p>在知识掌握方面，本课程要求和鼓励学生积极面向新兴的区块链经济现象广泛学习与吸收相关的技术产业成果，批判性地形成区块链技术知识、行业信息、政策情报的系统梳理，并积累理论分析基础。</p> <p>在方法训练方面，本课程学习和研究重在培养研究生结合经济学各学科原理，优化提升对区块链领域的理论分析能力，培育对区块链技术兴起背景下引发的生产关系、公司制度、通证设计、分配关系等实际问题的解读和解决能力。</p> <p>在综合运用方面，本课程结合校级区块链经济研究中心建设，鼓励学生参与区块链的产业科技实践，在区块链项目与案例分析、区块链产业分析、区块链服务能力建设、区块链培训与社群运营等方面引导学生进行开创性、实践性地探索。</p>							
<p>教学内容及安排（请注明各章节及学时）</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1. 区块链经济概述</li> <li>2. 区块链技术特性及经济涵义</li> <li>3. 区块链与数字货币</li> <li>4. 区块链与智能合约</li> <li>5. 区块链与通证激励</li> <li>6. 区块链与社群治理</li> <li>7. 区块链与公司组织制度变革</li> <li>8. 区块链项目的行业应用情景</li> <li>9. 区块链与生产关系变革</li> </ol>							
考核方式	课堂参与度（60%）+课程论文（40%）						
使用教材	<input type="radio"/> 自编讲义 <input type="radio"/> 已出版的自编教材 <input type="radio"/> 其他公开出版教材						
	《区块链：从数字货币到信用社会》，长铗 韩锋 等，中信出版社，2016年						

	6月出版。
参考书目	<p>《区块链：重塑经济与世界》，徐明星、刘勇、段新星、郭大治等，中信出版社，2016年出版。</p> <p>《区块链社会：解码区块链全球应用与投资案例》，龚鸣，中信出版社，2016年8月出版。</p> <p>《区块链：技术驱动金融》，阿尔文德·纳拉亚南等，中信出版社，2016年8月出版。</p> <p>《区块链革命：比特币底层技术如何改变货币、商业和世界》，【加】唐塔普斯科特，亚力克斯·塔普斯科特等，中信出版社，2016年8月出版。</p> <p>《区块链：量子财富观》，韩锋，张晓玫等，机械工业出版社，2017年6月出版。</p>

## 《证券投资技术分析》课程简明教学大纲

课程名称	证券投资技术分析			课程编号	0402f0009		
课程负责人	王正虎			课程负责人 所在单位	经济与管理学院		
教学团队成员	王正虎						
课程类别	选修课程		学时	36		学分	2
授课方式及 时数分配	集中讲授	组织研讨	实验分析	读书指导	实地调研	自主学习	其他
<p>课程定位、教学目的及要求、教学成效（请注明课程思政与国际化元素和方式）</p> <p>《证券投资技术分析》是金融学专业中的一门重要课程。通过本课程的学习，使学生理解证券投资技术分析的基本知识，掌握技术分析的图表类型和图标的刻度、K线理论、支撑压力理论、形态理论、波浪理论、技术指标等常用的技术分析方法，比较熟练地使用常用的技术分析软件，能够初步运用所学的知识分析证券市场中的价格走势。</p>							
<p>教学内容及安排（请注明各章节及学时）</p> <p>第一章 技术分析概述            识记：技术分析的定義。            理解：技术分析的理論基础。            简单应用：技术分析方法的分类。            综合应用：技术分析的特点和应注意的问题。            学时安排：4</p> <p>第二章 技术分析的图标类型和图表的刻度            识记：○×图，宝塔线。            理解：市场价格横截面图。            简单应用：多指标配合图。            综合应用：图表的刻度。            学时安排：4</p> <p>第三章 K线理论            识记：K线。            理解：单独一根K线的含义。            简单应用：K线组合形态。            综合应用：应用K线理论应注意的问题。            学时安排：4</p> <p>第四章 支撑压力-----切线理论            识记：趋势，支撑线和压力线，趋势线、轨道线和交叉线，黄金分割线和百分比线，扇形线、速度线和甘氏线。            理解：支撑线和压力线，趋势线、轨道线和交叉线，黄金分割线和百分比线，扇形线、速度线和甘氏线的原理。</p>							

简单应用：各种支撑线压力线的应用。  
 综合应用：使用支撑压力应该注意的问题。  
 学时安排：4

第五章形态理论

识记：双重顶和双重底，头肩顶和头肩底，三重顶和三重底，圆弧形态，三角形，矩形、旗形和楔形，喇叭形和菱形，“V”形，缺口和岛形反转。  
 理解：价格移动的规律和两种形态类型。  
 简单应用：各种形态的辨识与应用。  
 综合应用：应用形态理论应注意的问题。  
 学时安排：4

第六章 波浪理论

识记：斐波那契数列，主浪，调整浪。  
 理解：波浪理论的基本原理。  
 简单应用：波浪理论的比率分析和时间分析。  
 综合应用：波浪理论的应用实例。  
 学时安排：4

第七章 技术指标（1）

识记：MA 和 DMA、EXPMA 和 MACD、TRIX；WMS 和 KDJ；相对强弱指标 RSI；BIAS 和 OSC、ROC 和 MTM；ADL、ADR 和 OBOS。  
 理解：应用技术指标的几点说明。  
 简单应用：各种技术指标的应用。  
 学时安排：4

第八章 技术指标（2）

识记：AR、BR 和 CR；OBV、WVAD、ADVOL、Chai ki n 和 EMV；PSY 和 VR；DMI；SAR；BOLL、百分比轨道线指标和 CCI。  
 理解：各种技术指标的构成原理。  
 简单应用：技术指标的简单应用。  
 学时安排：4

第九章时间周期理论

识记：时间周期。  
 理解：时间周期分析。  
 简单应用：时间周期分析的一般运用。  
 综合应用：时间周期在深沪市场的实际应用。  
 学时安排：4

考核方式	期末闭卷考试（70%）与平时学生参与的模拟炒股实践成绩（30%）
使用教材	<input type="radio"/> 自编讲义 <input type="radio"/> 已出版的自编教材 <input checked="" type="radio"/> 其他公开出版教材 李向科：《证券投资技术分析》，中国人民大学出版社，2012 年 4 月第 4 版。） （经济管理类课程教材·金融系列；面向 21 世纪课程教材）
参考书目	罗伯特 D. 爱德华兹：《股市趋势技术分析》，机械工业出版社，2009 年 8 月第 1 版。 小查尔斯 D. 柯克帕特里克：《经典技术分析》，机械工业出版社，2012 年 7 月第 1 版。

	<p>小罗伯特·鲁格劳特·普莱切特：《艾略特波浪理论-市场行为的关键》，中国财经出版社，1998年12月第1版。</p> <p>江恩：《如何从商品期货交易 中获利》，机械工业出版社，2007年1月第1版。</p> <p>江恩（1999）：《华尔街四十五年》，机械工业出版社，2010年4月第1版。</p> <p>马丁·J. 普林格：《技术分析》，中国财政经济出版社，2003年11月第1版。</p>
--	---

## 《私募股权投资管理》课程简明教学大纲

课程名称	《私募股权投资管理》			课程编号			
课程负责人				课程负责人 所在单位	华南师范大学经济 与管理学院		
教学团队成员							
课程类别	选修		学时	32		学分	2
授课方式及 时数分配	集中讲授	组织研讨	实验分析	读书指导	实地调研	自主学习	其他
课程定位、教学目的及要求、教学成效（请注明课程思政与国际化元素和方式）							
<p>本课程旨在培养金融硕士，尤其是应用型专业硕士的实务操作经验和理论认知，根据当前最前沿的金融市场变化以及大资管行业演进规律，拓展金融硕士实务视野，了解多元化的金融业态，建立国际化的投资分析理念，理解国际主流的大型基金投资运作模式，并辅助于对国内资管行业发展的深入思考。</p>							
教学内容及安排（请注明各章节及学时）							
<p>1 私募股权基本要素</p> <p>1.1 商业模式</p> <p>1.2 投资理念</p> <p>1.3 投资周期</p> <p>1.4 基金管理公司</p> <p>1.5 投资收益</p> <p>2 私募股权发展历程</p> <p>2.1 早期的私募股权</p> <p>2.2 风起云涌的 1980 年代</p> <p>2.3 烈火烹油的 1990 年代</p> <p>2.4 21 世纪的私募股权</p> <p>2.5 私募股权行业现状</p> <p>2.6 中国的私募股权</p> <p>3 中美监管体系对比</p> <p>3.1 美国的私募股权监管体系</p> <p>3.2 中国私募股权监管探讨</p> <p>4 私募股权基金募集</p> <p>4.1 筹资对象</p> <p>4.2 筹资渠道</p> <p>4.3 募资要点</p> <p>5 私募股权基金架构设计</p> <p>5.1 有限合伙基金</p> <p>5.2 公司制基金</p>							



- 5.3 信托制基金
- 5.4 收益分配
- 5.5 税收的处理
- 5.6 中国基金注册事项
  
- 6 私募股权基金条款
  - 6.1 注册和组织事项
  - 6.2 资本事项
  - 6.3 分配事项
  - 6.4 权力架构
  - 6.5 投资运作
  - 6.6 清算、解散及终止
  - 6.7 其他事项
  
- 7 创业投资
  - 7.1 天使投资
  - 7.2 项目来源
  - 7.3 投资理念
  - 7.4 中国案例分析
  
- 8 成长资本策略
  - 8.1 投资理念
  - 8.2 中国 Pre-IPO 策略的发展
  
- 9 并购基金
  - 9.1 投资逻辑
  - 9.2 中国的并购策略
  - 9.3 经典案例：RJR-Nabisco
  - 9.4 中国式收购：中国玻璃
  
- 10 投资评估
  - 10.1 概述
  - 10.2 投资评估流程
  - 10.3 项目渠道
  
- 11 尽职调查
  - 11.1 概述
  - 11.2 业务尽调
  - 11.3 财务尽职调查
  - 11.4 法律尽职调查
  - 11.5 项目筛选报告 / 投资报告书
  
- 12 投资条款书

12.1 概述 12.2 财务条款  13 企业估值 14 投后管理 15 退出策略	
考核方式	过程考核：小组论文+展示汇报 期末考核：期末考试
使用教材	<input type="radio"/> 自编讲义 <input type="radio"/> 已出版的自编教材 <input checked="" type="checkbox"/> 其他公开出版教材 (请注明使用教材名称、作者/主编、出版单位、出版年份、版次) 《私募股权投资管理》、欧阳良宜、北京大学出版社、2013 年出版、版次 1
参考书目	《精通私募股权（全球金融与投资佳作精选）》 《私募股权投资基金实务操作指引（修订）》 《私募股权基金筹备、运营与管理：法律实务与操作细节》

## 《金融法》课程简明教学大纲

课程名称	金融法			课程编号			
课程负责人				课程负责人 所在单位		经济与管理学院	
教学团队成员							
课程类别	选修课程		学时	36		学分	2
授课方式及 时数分配	集中讲授	组织研讨	实验分析	读书指导	实地调研	自主学习	其他
<p>课程定位、教学目的及要求、教学成效（请注明课程思政与国际化元素和方式）</p> <p>随着社会主义市场经济的不断发展，人们的经济交往逐渐频繁和复杂，经济领域，特别是金融领域存在的问题也日益增多，各种违法犯罪现象日益严重。熟悉和掌握该领域的法律知识，是我们有效解决这些问题的关键所在。金融法学在整个法学体系中的地位十分重要，实际运用十分广泛。开设本课程，旨在使学生全面系统地掌握金融法的基本理论、基本知识、基本技能以及我国金融法律制度的主要内容，培养学生运用金融法学的基本理论，分析和解决金融领域乃至经济领域法律问题的能力。</p>							
<p>教学内容及安排（请注明各章节及学时）</p> <p>第1章 金融法总论（3个学时）</p> <p>（1）金融、信用、金融法的概念与特征；</p> <p>（2）金融法律关系的要素及金融法的调整对象；</p> <p>（3）我国金融立法体系和立法趋势。</p> <p>第2章 银行法（上）（4个学时）</p> <p>（1）银行的概念、职能及分类；</p> <p>（2）我国现行银行体系；</p> <p>（3）中央银行法、商业银行法；</p> <p>（4）相关政策性银行法。</p> <p>第3章 银行法（下）（4个学时）</p> <p>（1）我国银行存款、贷款业务的基本规则；</p> <p>（2）支付结算法律制度和银行电子化的法律问题；</p> <p>（3）现行的结算方式和支付工具；</p> <p>（4）我国银行新兴业务种类。</p> <p>第4章 货币法（5个学时）</p> <p>（1）货币的职能和形式；</p> <p>（2）人民币的法律地位及其法律保护；</p> <p>（3）人民币发行和流通制度；</p> <p>（4）我国反洗钱的基本情况。</p> <p>第5章 票据法（5个学时）</p> <p>（1）票据的概念、特征；</p> <p>（2）票据法律关系；</p>							

<p>(3) 票据行为；</p> <p>(4) 汇票、本票、支票的基本法律制度。</p> <p>第 6 章 证券法（5 个学时）</p> <p>(1) 证券的概念、特征和分类；</p> <p>(2) 证券法的基本原理和基本制度；</p> <p>(3) 证券投资基金的基本知识。</p> <p>第 7 章 信托法（5 个学时）</p> <p>(1) 信托制度产生的历史背景和发展过程；</p> <p>(2) 信托的概念、特征与种类；</p> <p>(3) 信托设立、变更和终止的基本规则；</p> <p>(4) 信托法律制度的基本内容。</p> <p>第 8 章 保险法（5 个学时）</p> <p>(1) 保险的概念、要素和分类；</p> <p>(2) 保险法律关系的基本内容；</p> <p>(3) 我国保险法的主要内容。</p>	
考核方式	开卷考试（平时成绩 60%+期末成绩 40%）
使用教材	<input type="radio"/> 自编讲义 <input type="radio"/> 已出版的自编教材 <input type="radio"/> 其他公开出版教材 （请注明使用教材名称、作者/主编、出版单位、出版年份、版次）
	《金融法学》，强力主编，高等教育出版社，2003 年版。
参考书目	《金融法》，朱大旗主编，中国人民大学出版社，2000 年版。 《金融法学》，汪鑫主编，中国政法大学出版社，2002 年版。

## 《金融史》课程简明教学大纲

课程名称	金融史			课程编号			
课程负责人	张球			课程负责人 所在单位			
教学团队成员							
课程类别	选修		学时	36		学分	2
授课方式及 时数分配	集中讲授	组织研讨	实验分析	读书指导	实地调研	自主学习	其他
<p><b>课程定位、教学目的及要求、教学成效（请注明课程思政与国际化元素和方式）</b></p> <p>所谓金融史，简单地说，就是关于资金融通的历史，包括广义和狭义方面，本课程介绍金融发展变迁的有关历史，包括金融的变迁与发展、影响世界历史进程的变迁与并购、重大的金融事件等。金融史也是一部寄托于金钱的人类欲望的历史。2008年，雷曼危机让世界陷入金融危机的漩涡。由于自身的欲望，人类自古就不断重蹈覆辙。然而不可否认的是，人类所掌握的金融技术，在漫长的岁月变迁中也在逐步改善。金融在被用于筹集军费的同时，也在发挥着积极的作用，如国债的发明，企业的创建，为人才精英提供资金等。此外，在铺设铁路、研发飞机、研制新药，以及通过互联网建立覆盖全球的信息网络等方面，金融都起到了协助、促进的作用。通过对数千年来金融在全世界范围内扮演的重要角色的探索，了解金融工具和金融体系如何推动了城市中心的扩张，并促进了文明的繁荣。本课程设置的目的是使学生了解金融历史发展演变，包括各个时期国家的货币种类和使用情况，有关的政策、法规，货币流通中的矛盾问题，官府和民间的金融借贷活动；为学生分析判断中国当今金融运行中存在的主要矛盾和问题提供了历史借鉴。</p>							
<p><b>教学内容及安排（请注明各章节及学时）</b></p> <p><b>第1章 中世纪金融</b></p> <p style="padding-left: 20px;">了解基督教的金融政策；认识金融与地理的关系；了解威尼斯金融的兴起及银行的诞生。</p> <p><b>第2章 荷兰金融</b></p> <p style="padding-left: 20px;">了解荷兰金融的发展方式；东印度公司，阿姆斯特丹股票交易所；荷兰的对外投资及战争；衰败的原因等。</p> <p><b>第3章 英国金融</b></p> <p style="padding-left: 20px;">认识英国金融的发展动因及方式；英格兰银行诞生及运作模式，伦敦金融城，分析其衰落的原因。</p> <p><b>第4章 美国金融</b></p> <p style="padding-left: 20px;">了解华尔街的崛起之路；大萧条及金融的规范运作方式；认识美国称霸世界的时代背景及政策分析。</p> <p><b>第5章 日本金融</b></p> <p style="padding-left: 20px;">认识第二次世界大战前后的日本金融市场；日本泡沫经济的形成原因等。</p> <p><b>第6章 中国金融</b></p> <p style="padding-left: 20px;">认识新中国建立和国民经济恢复时期的金融；“一五”计划建设时期的金融；“大跃进”及调整时期的金融；“文革”时期的金融；拨乱反正时期的金融；新中国各时期的金融政策思想。</p>							

考核方式	
使用教材	<input type="radio"/> 自编讲义 <input type="radio"/> 已出版的自编教材 <input type="radio"/> 其他公开出版教材 (请注明使用教材名称、作者/主编、出版单位、出版年份、版次) 《世界金融史》(日)板谷敏彦 著,机械工业出版社,2018 年版
参考书目	1. 千年金融史 (美)威廉·戈兹曼(William N.Goetzmann) , 中信出版社,2017 年版; 2. 世界是部金融史 陈雨露, 杨栋著, 北京出版社, 2011 版; 3.伟大的博弈 华尔街金融帝国的崛起 [美] 约翰.S. 戈登 著, 2019 年版; 4. 中国金融史 燕红忠, 上海财经大学出版社, 2020 年版 5.美联储传 一部现代金融史 ,G.爱德华·格里芬 , 中信出版社,2017 年版; 6.美国金融史(全六卷), 杰瑞·马克汉姆 (Jerry W.Markham) 著, 中国金融出版社, 2017 年版; 7.现代金融创新史: 从大萧条到美丽新世界, 辛乔利 著, 社会科学文献出版社, 2019 年版; 8.世界经济简史, [德] 马克斯·韦伯 著, 李慧泉 译, 立信会计出版社, 2018 年版

## 《行为金融学》 课程简明教学大纲

课程名称	行为金融学			课程编号	0402c0009		
课程负责人	连洪泉			课程负责人 所在单位	经济与管理学院		
教学团队成员							
课程类别	专业选修		学时	36		学分	2
授课方式及 时数分配	集中讲授	组织研讨	实验分析	读书指导	实地调研	自主学习	其他
	18	10	8				
课程定位、教学目的及要求、教学成效（请注明课程思政与国际化元素和方式）							
<p><b>课程定位</b>  <b>专业选修课</b>，为金融专业硕士一年级学生讲授行为金融学专题，引导学生阅读和掌握国际前沿的行为金融学主要研究主题、研究方法和研究结论，提高国际前沿的金融专业研究素养。</p> <p><b>教学目的</b>            1. 提高金专学生国际前沿的金融专业素养。课程将向学生讲授前沿的个体投资者、市场的信息效率和泡沫、认知金融和社交金融的行为金融学专题内容，以此完善金专学生的传统金融学和前沿行为金融学知识结构，培养金专学生国际前沿的金融素养；            2. 培养学生理性投资理念和跨学科视角。通过课程教学和互动引导学生形成理性的投资理念，树立融合心理学、经济学、社会学和金融学等跨学科研究视角，提高学生阅读和领悟国际前沿研究文献能力。</p> <p><b>教学要求</b>            1. 要求学生能够阅读行为金融学相关研究主题英文文献；            2. 要求学生参与课堂行为实验并参与课堂讨论；            3. 要求学生能够熟练掌握论文分析方法，翻译或者写作一篇跟行为金融相关话题的研究论文。</p> <p><b>教学成效</b>            1. 学生能够熟练阅读行为金融学英文文献，并完整报告论文核心思想和结论；            2. 学生能够了解和掌握行为金融学前沿研究主题内容；            3. 学生能够掌握行为金融学论文写作方法技能；</p>							

<p>教学内容及安排（请注明各章节及学时）</p> <p>第一讲 行为金融学入门 （6学时） 重点讲有效市场假说、市场模型和行为金融基本知识点</p> <p>第二讲 个体投资者 （6学时） 主要讲过度自信、超额交易、损失厌恶、近视损失厌恶、风险承担、情绪和股票回报等话题。</p> <p>第三讲 市场效率 （6学时） 主要涵盖信息效率、对新闻的过度反应和反应不足、市场泡沫、过度自信等行为金融话题</p> <p>第四讲 认知和社交金融 （6学时） 主要涵盖认知金融、认知和泡沫、社交金融等行为金融话题。</p> <p>第五讲 行为金融学前沿研究方法 （4学时） 主要涵盖行为经济学、神经经济学和实验经济学等行为金融研究方法论话题。</p> <p>第六讲 行为金融学前沿话题分享 （8学时） 主要由学生分小组汇报前沿研究文献、前沿书籍文献内容，并参与课堂讨论。</p> <p><b>注：课程讲义是中英文PPT，中文讲解。</b></p>	
考核方式	考勤、课堂参与和文献汇报（50%）+论文撰写（50%）
使用教材	<input checked="" type="checkbox"/> 自编讲义 <input type="checkbox"/> 已出版的自编教材 <input type="checkbox"/> 其他公开出版教材 （请注明使用教材名称、作者/主编、出版单位、出版年份、版次）
参考书目	1. Itzhak Venezia, Behavioral Finance: A Novel Approach, World Scientific, 2021 2. Thorsten Hens, Marc Oliver Rieger, Financial Economics: A Concise Introduction to Classical and Behavioral Finance, Springer, 2016. 3. Edwin T. Burton, Sunit N. Shan, Behavioral Finance: Understanding the Social, Cognitive, and Economic Debates, Wiley & Sons, 2013.