

金融 I

课程编号: 02812150

授课对象: 金融硕士

学 分: 2

任课教师: 卢瑞昌

课程类型: 必修

开课学期: 2014 秋

先修课程: 无

任课教师联系方式: RuichangLu@gsm.pku.edu.cn

辅导、答疑时间: 周一 2:00 pm 至 5:00 pm

一、项目培养目标

学习目标 1 教授学生最新的金融学、经济学和管理学的理论知识,培养学生综合运用理论知识和解决实际金融问题的能力。

具体目标 1 系统掌握金融学、经济学和管理学的理论知识

具体目标 2 掌握数量化与分析问题的能力

具体目标 3 能够综合应用所学的理论知识和方法解决实际问题

学习目标 2 培养学生良好的沟通能力,使之适应在各类金融机构和企业的工作。

具体目标 1 具备良好的口头交流

具体目标 2 具备良好的书面交流能力

具体目标 3 具备良好的团队合作精神

学习目标 3 具有良好的社会责任感和伦理道德观

学习目标 4 具有国际化的视野

具体目标 1 理解金融的商业环境存在文化差异

具体目标 2 了解全球不同的金融体系

具体目标 3 适应在跨国金融机构有效工作。

二、课程概述

以公司运营中所处的整体金融环境为背景,该课程帮助学生理解公司财务分析的核心概念和核心工具。该课程将教授可以用来评估各种公司财务决定的若干分析框架,为学生提供一个学习和理解公司金融理论,以及如何在实战中应用这些理论。

三、课程目标 (包括学生所提高的技能要求), 本课程目标如何服务于项目的培养目标

该课程围绕着公司如何在一个不确定的环境下做出重要财务决策而展开。课程涉及到的决策包括:

(1) 投资决策——即,投在哪个项目? 怎样评估一个公司或一种金融资产?

- (2) 融资决策——即，企业怎样从资本市场，或广义的讲，从金融体系中获得所需资金？各种融资渠道的成本如何计算？与之相关的一个问题是怎样决定一个企业的资本结构？
- (3) 资本市场诊断——如何利用资本市场信息来做出公司层面上的正确决定？

四、内容提要及学时分配

- Net Present Value (RWJ, Ch1, 3, 4) <Week 1-2>
- Investment Rules and Capital Budgeting (RWJ, Ch5) <Week 3>
- Risk Analysis and Real Options (RWJ, Ch8) <Week 4>
- Valuation of Bonds and Stocks (RWJ, Ch8, 9) <Week 5-6 including midterm exam >
- Risk-return (RWJ, Ch10, 11, 12) <Week 7 >
- Market Efficiency (RWJ, Ch14 and supplemental readings) <Week 8>
- Capital Structure (RWJ, Ch 16, 17) <Week 9-10>
- Options (RWJ, Ch22, 25 and supplemental readings) <Week11-12 >

五、教学方式

以老师讲解为主，学生可以自由提问并参与课堂讨论。

六、教学过程中 IT 工具等技术手段的应用

PPT 和黑板结合使用，以 PPT 为主。

七、教材

Corporate Finance, 9th Edition by Stephen Ross, Randolph W. Westerfield and Jeffrey Jaffe

八、参考书目

九、教学辅助材料，如 CD、录影等
课堂相关论文或案例

十、课程学习要求及课堂纪律规范

上课之前做好一定的预习，课堂认真听讲。要求对教学内容灵活掌握，而不是死记硬背。学生必须遵守学校的一般纪律安排。

十一、学生成绩评定办法（需详细说明评估学生学习效果的方法）

课堂参与	5%
论文陈述或案例分析	10%
期中随堂测验	25%
期末考试:	<u>60%</u>

总共

100%

十二、项目培养目标的考核方式与标准（仅适用于参与保障教学效果评估 (Assurance of Learning) 的课程，该部分可以由教务部门与任课老师沟通后填写，认证涉及课程：金融学概论、金融计量经济学 II、证券投资学、实证金融、货币金融理论、金融工程、管理学、微观经济学)