

## 实证金融

课程编号: 02812280

学分: 2

课程类型: 专业必修

先修课程: 金融学概论、证券投资学、公司财务、计量经济学

授课对象: 金融硕士

任课教师: 刘玉珍、张翼、张峥

开课学期: 2013 秋

任课教师联系方式:

刘玉珍教授 光华 2 楼 324, 电话: 62757699; Email: [yiliu@gsm.pku.edu.cn](mailto:yiliu@gsm.pku.edu.cn)

辅导、答疑时间: 星期五下午 2 点

### 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

本课程主要通过实证金融学研究文献的讨论, 介绍资产定价和公司财务领域的实证研究设计与方法, 金融数据的应用与计算分析。课程内容包括: 概述、论文写作, 中国市场研究介绍, 实证研究方法介绍, 行为金融, 市场微结构, 家庭金融, 证券发行, 金融中介, 公司财务。

### 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

本课程的主要的培养目标是：通过课程的学习，学生可以了解相关领域的研究进展，独立设计实施一个实证金融的研究项目，并规范地完成论文的写作。

### 四、内容提要及学时分配

	内容	学时	上课时间
1	概述、论文选题与写作	3 学时	2013 年 9 月 11 日
2	中国市场研究介绍	3 学时	2013 年 9 月 18 日
3	实证研究方法介绍	3 学时	2013 年 9 月 25 日
4	放假		
5	行为金融	3 学时	2013 年 10 月 9 日
6	市场微结构	3 学时	2013 年 10 月 16 日
7	家庭金融	3 学时	2013 年 10 月 23 日
8	证券发行	3 学时	2013 年 10 月 30 日
9	金融中介	3 学时	2013 年 11 月 6 日
10	公司财务	3 学时	2013 年 11 月 13 日
11	考试	3 学时	2013 年 11 月 20 日

### 四、阅读材料

上课教材与学术论文

### 五、教学方式

讲授与讨论

### 六、教学过程中 IT 工具等技术手段的应用

### 七、教材

国际主要期刊

### 八、参考书目

九、教学辅助材料，如 CD、录影等

## 十、课程学习要求及课堂纪律规范

1. 选课学生分为 24 个讨论小组，每组 4 人；本课程安排 24 篇实证研究文献的阅读，学生必须认真阅读文献，每个讨论小组书写并提交阅读报告；
2. 本课程共安排 6 次课堂讨论，每次讨论 4 篇实证研究文献，每篇文献由一个讨论小组宣讲。

## 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）

课堂讨论和阅读报告: 50%  
期末考试（闭卷）: 50%