

金融 III

课程编号: 02802170

授课对象: 金融硕士

学 分: 2

任课教师: 杨云红

课程类型: 必修

开课学期: 2014 春

先修课程: 金融 I,II

联系方式: 电话: 010-62759182 E-mail: yhyang@gsm.pku.edu.cn

辅导、答疑时间: (待与学生商定)

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

本课程讲授期望效用函数理论与行为金融、随机占优理论、最优投资组合理论、两基金分离与线性估值、配置效率与状态或有性证券的估值、衍生品定价理论、不对称信息条件下的资产定价等经典理论,并介绍金融经济学领域的最新发展。

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

本课程是金融经济学的高阶课程,目的在于提高金融硕士在金融学领域的学术素养和理论层次。通过本课程,学生能够掌握金融经济学的核心内容,并了解金融经济学领域的最新发展。

四、内容提要及学时分配

期望效用函数理论与行为金融（3 学时）

随机占优理论（3 学时）

最优投资组合理论（6 学时）

两基金分离与线性估值（3 学时）

配置效率与状态或有性证券的估值（3 学时）

衍生品定价理论（3 学时）

多期动态模型（6 学时）

不对称信息条件下的资产定价（6 学时）

五、教学方式

以教师讲授为主。欢迎学生在课堂随时提问，发表观点，积极参与讨论。

六、教学过程中 IT 工具等技术手段的应用

课程提供讲义

七、教材

八、参考书目

Huang, C. and R. H., Litzenberger, Foundations for Financial Economics, Elsevier Science Publishing Co., Inc., 1988.

除参考书外，还会随堂布置课外阅读材料

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

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）

考试为笔试，在期末进行。

成绩计算方法：课堂参与（15%）+ 作业（45%）+ 期末考试（40%）