

## 课程大纲

### 金融市场与金融机构

课程编号：02802490  
学 分：2  
课程类型：选修  
先修课程：

授课对象：金融硕士  
任课教师：陈佳  
开课学期：2015 年春

#### 任课教师简历（500 字左右）：

陈佳老师于 2012 加入北京大学光华管理学院。他的主要研究兴趣是资产定价。他的当前研究也包括金融机构，金融危机，以及国际金融。在加入北大光华之前，他曾在俄亥俄州立大学的菲舍尔商学院教授过课程。

他于 2003 年在中国科学技术大学取得物理学学士学位。2006 年和 2012 年，他在俄亥俄州立大学分别取得了物理学硕士学位和金融学博士学位。



#### 任课教师联系方式：

光华新楼 302  
电子邮件：chen.1002@gmail.com  
办公室电话：010-62767941  
课程网页：chenjia.gsm.pku.edu.cn

#### 助教姓名及联系方式：

张培园（1301211823@pku.edu.cn）

#### 辅导、答疑时间：

预约

#### 一、项目培养目标

**Program objective 1** Introducing frontier theories of finance, economics, and management; helping students establish the ability to apply theoretical knowledge and solve real world financial problems.

Specific objectives include

- Obtaining systematic understanding of finance, economics, and management theories;
- Mastering quantitative analysis skills;
- Applying theoretical knowledge in class to real problems.

**Program objective 2** Building strong communication skills to help students work in financial institutions and companies. Specific objectives include

- Fostering strong oral communication skills;
- Fostering effective written communication skills;
- Building team work spirits.

**Program objective 3** Establishing social responsibility and business ethics.

**Program objective 4** Gaining an international perspective. Specific objectives include

- Understanding the cultural variety in the financial industry;
- Knowing different financial systems around the world;
- Preparing for effective work at multinational financial institutions.

## 二、课程介绍

本课程旨在提高和加深学生们对金融市场和金融机构的理解和认识。本课程将以理论为指导，侧重于理解实务中具体的问题与事例。

## 三、教学方法

本课程将使用课堂教学、案例分析、课堂讨论、课堂测验等方式来达到教学目的。学生们需要在讨论案例时和其他课堂讨论时积极参与到讨论中来。

## 四、课程材料

**教科书** Frank J Fabozzi, Franco P. Modigliani, and Frank J Jones, Foundations of Financial Markets and Institutions, 金融市场与金融机构基础, 第四版, 机械工业出版社影印本, 2011

**参考书** 上书中译本, 孔爱国等译, 《金融市场与金融机构基础》(原书第4版), 机械工业出版社, 2010

**其他课件** 为了方便同学们理解课程内容, 我会在课堂上把讲义、案例、阅读材料发给同学们, 还会把其他材料放到课程网页上。

## 五、评分方法

最终成绩计算方法如下:

一次小组报告	45%
个人期末论文成绩	45%
个人课程参与	10%

### 1 一次小组报告

我会指定小组对于某一个专题作报告。专题的题目列在后面的“课程计划和预计时间表”中。报告的要求如下:

- 在被指定的专题中选择一个具体问题或者方向, 并说明这个问题或者方向的重要性。组织事实和数据来回答所提出的问题。
- 请在3月3日之前组成小组并将小组的组成情况通知给助教。我会随后确定每个小组的报告题目。

### 2 期末论文

论文最长为5页, 由同学们选择个人最感兴趣的题目。同学们应在4月7日上课前提交论文。论文的具体要求有以下几点:

- 论文应该提出并回答一个具体的问题。请根据自己的兴趣和经历并结合本课程的内容来选择问题。请不要写太笼统的问题。如果不确定论文的题目或者是问题是否合适, 可以和我联系。
- 论文应该清楚地对所提出问题的重要性表达出来。论文应结合所学理论、个人经历、以及现实中的现象问题的答案的价值。
- 论文应该通过事实或者数据来组织论点并回答所提出的问题。这些事实和数据应和论文的问题紧密相关。论文应很好地将这些事实和数据组织起来。请根据学术论文的格式标注引文并排列参考文献。

### 3 课程参与

课程成绩的一部分是基于课堂参与。我希望同学们积极参与到课堂讨论中来。课堂参与的评分主要是基于同学个人在课堂教学、案例讨论、以及其他方面的参与情况。我会用课前布置任务和课堂中体温的方式来

提高课堂参与度。每个同学将有充足的课堂参与的机会。我和助教将会随时记录课堂参与的情况。如果同学因特殊情况需要缺课，请用电子邮件通知助教或者我。

## 六、答疑时间

如同学有疑问，可以随时向我和助教提出来。我可以在每次课后回答问题。同学们也可以通过电子邮件或者其他方式和我或者助教预约其它的答疑时间。

## 七、课程计划和预计时间表

**课程计划和预计时间表可能会改变。如有改变，我会以合适的方式通知同学们。**

---

3月2日	课程介绍
3月3日	存款性金融机构
3月9日	存款性金融机构 专题：小额信贷
3月10日	非存款性金融机构 专题：信托
3月16日	非存款性金融机构 专题：网络金融
3月17日	市场的组织与结构 专题：政策银行和资产管理公司
3月23日	市场的组织与结构 专题：创业板与新三板
3月24日	股权市场 专题：私募股权
3月30日	股权市场 专题：地方融资平台
3月31日	债权市场 专题：理财产品
4月7日	债权市场 专题：公司债

---