

课程大纲

课程编号：02812220

授课对象：2012 级金融硕士

课程名称：金融学概论

英文名称：Foundations on Finance

周学时/总学时：3/36

学 分：2

任课教师：刘琦

开课学期：2012 年秋

先修课程：《微观经济学》 《宏观经济学》

任课教师联系方式：

辅导、答疑时间：

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

本课程旨在解读现代金融学的基本概念、理念、分析框架、理论工具及其应用，涵盖货币金融学、资产定价和公司财务的关键内容。目的在于使同学们建立一个关于现代金融学整体框架的知识结构，注重理清课程内容中的概念、思想、直觉、逻辑分析框架和理论溯源，为今后深入学习各专业课做一个基础性铺垫。

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

在课程结束时，学生应该能够：

1. 正确理解货币、信用的内涵，金融系统的构成、功能、特征及其运行。
2. 理解货币的时间价值、现金流量分析，掌握债券和股票价值的基本评估方法。
3. 正确理解经典金融学的理论基石——有效市场理论。
4. 掌握经典金融学的资产定价理论模型——CAPM、APT
5. 掌握经典金融学的资本结构理论与股利政策理论，正确理解 MM 定理。
6. 掌握行为金融学的基本观念与分析方法，对照“反省”经典金融学的相关理论，并能适当阐释现实社会经济生活中的相关问题。
7. 提高从金融学视角观察现实、发现问题、分析问题的能力。

四、内容提要及学时分配

9月12日 导论

9月19日 金融体系及其特征

9月26日 时间价值、现金流量与跨期资源配置

10月3日 国庆放假

10月10日 资本预算分析

10月17日 有效市场理论

10月24日 行为金融学导论

10月31日 价值评估模型——债券和股票的估值

11月7日 风险管理与投资组合选择

11月14日 资本资产定价模型与套利定价理论

11月21日 资本结构理论

五、教学方式

课堂讲授为主

六、教学过程中 IT 工具等技术手段的应用

PPT 课程讲义

七、教材

1. 兹维·博迪 罗伯特·C·莫顿 戴维·L·克利顿，《金融学》(第二版)，中国人民大学出版社，2010。

Zvi Bodie, Robert C. Merton, David L. Cleeton, *FINANCIAL ECONOMICS*,

Second Edition, Pearson Education International, 2009。

2. 刘力,《公司财务》,北京大学出版社,2007。

八、参考书目

1. Stephen A. Ross, *Neoclassical Finance*, Princeton University Press, 2005 (中文版: (美)斯蒂芬·A·罗斯|,《新古典金融学》,中国人民大学出版社,2009)。
2. ROGER E. A. FARMER, *How the Economy Works*, Confidence, Crashes and Self-Fulfilling Prophecies, Oxford University Press, Inc, 2010。
3. [美]罗伯特·博森,《大乱有大治:如何治理美国的金融系统》(**Too Big To Save? How to Fix the U.S. Financial System**), 中信出版社,2010。
4. [美]西蒙·约翰逊 郭庾信,《13个银行家:下一次金融危机的真实图景》(13 bankers: The wall street takeover and the next financial meltdown), 中信出版社,2010。
5. Peter L. Bernstein, *Capital ideas evolving*, John Wiley & Sons, Inc., 2007 (中文版: (美)彼得 L.伯恩斯坦,《投资新革命》,机械工业出版社,2010。)
6. 赫什·舍夫林(Hersh Shefrin),《超越恐惧和贪婪——行为金融学与投资心理诠释》,上海财经大学出版社,2005。
7. 赫什·舍夫林(Hersh Shefrin),《行为公司金融——创造价值的决策》,中国人民大学出版社,2007。
8. 安德瑞·史莱佛(Andrei Shleifer),《并非有效的市场——行为金融学导论》,中国人民大学出版社,2003。

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

认真出勤、听讲,欢迎上课提问、讨论;阅读教材和参考书目。

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 20%,作业 20%,期末闭卷考试 60%;