

课程大纲

课程名称：金融经济学

开课学期：2013 秋

先修课程：高级微观、高级宏观、高级计量

任课教师：徐建国

联系方式

电话：62759293, 13810182472

办公室：624

邮件：jgxu@ccer.edu.cn

一、课程概述

本课程为研究生二年级课程，在一年级基础课程学习的基础上，介绍金融学的基本理论框架和实证方法，并结合金融市场中的现象，特别是中国金融市场中的有关现象，选择感兴趣的问题开始培养理论运用、数据分析等方面的能力。

二、课程目标

介绍金融学的基本理论框架

熟悉金融市场、金融数据，培养数据分析能力

提高论文演讲、写作能力

三、授课方式

教师授课和学生讨论相结合，教师讲授基本理论和方法，学生选择一篇感兴趣的论文（须征得任课教师同意）进行宣讲，要求能够准确理解、清晰表达文章内容的相关理论。在宣讲论文的基础上，结合金融市场中的现象，提交一份研究设计，并报告初步研究结果。研究计划可以合作，但是最多限于两人。

四、考核方式

报告论文（40%）+研究设计（40%）+课堂讨论（20%）

五、课程内容

第一部分、资产定价

资产组合理论

资产定价模型

套利定价理论

衍生证券

行为金融

实证资产定价

投资绩效评估

第二部分、公司金融

第三部分、金融市场结构

六、参考书

本课程没有指定教科书，以阅读文献和讲义为主，以下为主要参考书。

Luenberger, David G., *Investment Science*, Oxford University Press, 1998.

Bernstein, Peter. *Capital Ideas: the Improbable Origins of Modern Wall Street*. New York, NY: Free Press, 1993.

Bodie, Zvi, Alex Kane, and Alan Marcus. *Investments*. 8th ed. New York, NY: McGraw-Hill/Irwin, 2008.

Berk, Jonathan, and Peter DeMarzo, *Corporate Finance*, 2nd edition, 2011, Prentice Hall.

Brealey, Richard, Stewart Myers, and Franklin Allen. *Principles of Corporate Finance*. 9th ed. New York, NY: McGraw Hill, 2007.

七、阅读文献 (to be added)