**厦门大学研究生课程教学大纲范本**

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 开课学院/研究院 | **经济学院** | 授课学期 | **2018年春季** |
| 课程名称 | 高级金融经济学 | | |
| 课程英文名称 | Advanced Financial Economics | | |
| \*课程编码 | 050010008 | 面向对象 | 学院硕、博一年级研究生 |
| 先修课程或  预备知识要求 | 高级微观经济学I，高级宏观经济学I，微积分，概率论与数理统计 | | |
| 课程学科分类 | □一级学科课程 □二级学科课程 □研究方向课程 | | |
| 课程内容分类  （可多选） | □理论讲授类 □实验类 □实务或实践类 □研究方法类 □研讨类  □文献类 □其他 （请注明） | | |
| 总学分/总学时 | 4/56 | 实践（含实验）学时 |  |
| 任课教师 | 张烁珣/林娟/纪洋/马超 | 联系方式 |  |
| 助教 |  | 联系方式 |  |
| **中文课程简介**  **(Course description in Chinese)** | 对此门课程要达到的教学目标的描述和分析，体现教师的教学理念。300-500字为宜。  本课程旨在为经济学院各专业一年级硕士和博士研究生介绍现代金融学理论的微观基础。通过本课程的学习，学生将掌握金融学的两种主要研究方法：均衡分析法和无套利分析法，并掌握如何运用这两种方法对金融资产进行定价。  本课程主要介绍资产定价和资产组合选择的相关内容。课程涵盖的主要内容包括：不确定性条件下消费者的决策（第三章），风险厌恶与投资决策（第四、五、六章），资本资产定价模型（第八章），Arrow-Debreu定价理论（第九、十一章）以及套利定价理论（第十四章）等等。 | | |
| **英文课程简介**  **(Course description in English)** | Describe the teaching aims of this course, and state your teaching ideas and philosophy. 300-500 words are recommended.  This course introduces the modern Financial theory and its micro foundation to the first-year graduate students. Students are required to command two major research methodologies: equilibrium analysis and no arbitrage analysis; and they are also required to know how to price the financial assets using the two methodologies.  This course introduces the modern financial theory and its micro foundation, which covers Making choices in risky situations, Measuring risk and risk aversion, The CAPM, Arrow-Debreu Pricing and APT, etc. | | |
| **课程内容**  **与预期成果(Course content & Expected Learning Outcomes)** | 列出课程的内容概要和计划进度。  列出任课教师希望通过此门课程达到的学习成果，包括掌握知识/技能层面、发展能力层面、培养态度和价值观层面等。  本课程主要介绍资产定价和资产组合选择的相关内容。课程涵盖的主要内容包括：不确定性条件下消费者的决策（第三章），风险厌恶与投资决策（第四、五、六章），资本资产定价模型（第八章），Arrow-Debreu定价理论（第九、十一章）以及套利定价理论（第十四章）等等。   |  |  |  | | --- | --- | --- | | **第1周** | 第1章：金融市场与金融机构的角色  第2章：资产定价面临的挑战  第３章：风险条件下的决策理论  Making choices in risky situations | 课堂讲授 | | **第2周** | 第４章：度量风险与风险厌恶  Measuring risk and risk aversion | 课堂讲授 | | **第3周** | 第４章：度量风险与风险厌恶Measuring risk and risk aversion | 课堂讲授 | | **第4周** | 第５章：风险厌恶与投资决策，第一部分MPT | 课堂讲授 | | **第5周** | 第６章：风险厌恶与投资决策，第二部分，现代组合理论MPT | 课堂讲授 | | **第6周** | 第8章：资本资产定价模型CAPM | 课堂讲授 | | **第7周** | 第8章：资本资产定价模型CAPM | 课堂讲授 | | **第8周** | 第9章：Arrow-Debreu定价，第一部分A-D Pricing | 课堂讲授 | | **第9周** | 第9章：Arrow-Debreu定价，第一部分A-D Pricing | 课堂讲授 | | **第10周** | 第１1章：Arrow-Debreu定价，第二部分A-D Pricing | 课堂讲授 | | **第11周** | 第１1章：Arrow-Debreu定价，第二部分A-D Pricing | 课堂讲授 | | **第12周** | 第１1章：Arrow-Debreu定价，第二部分A-D Pricing | 课堂讲授 | | **第13周** | 第１4章：套利定价理论APT | 课堂讲授 | | **第14周** | 第１4章：套利定价理论APT | 课堂讲授 | | **第15周** | 期末考试 |  | | **第16周** | 期末考试 |  | | | |
| **教学方式**  **和学习活动(Teaching and learning activities)** | 列出教师的教学方式和计划开展的学习活动内容，应与前列课程目标和预期学习成果相对应。  本课程主要介绍资产定价和资产组合选择的相关内容。课程涵盖的主要内容包括：不确定性条件下消费者的决策（第三章），风险厌恶与投资决策（第四、五、六章），资本资产定价模型（第八章），Arrow-Debreu定价理论（第九、十一章）以及套利定价理论（第十四章）等等。 | | |
| **考核方式**  **Assessment Criteria** | 明确列出每一种考核方式的权重及评价标准，并说明对学术诚信的具体要求和核查措施。  本门课程有四次作业。作业必须用英文写作。期中期末考试采用闭卷笔试。  成绩占比如下：期中考试35%，期末考试45%；四次作业16%（每次作业占4%）；课堂表现占4%（参与情况占2%，表现情况占2%） | | |
| **学习资源(Learning Resources)** | 包括教材、参考书、参考文献，以及其他获取课程学习资源的途径等。  Jean-Pierre Danthine and John B. Donaldson, 2005, Intermediate Financial Theory (2nd ed), Elsevier Academic Press.  **主要参考书：**  C.F. Huang and R. Litzenberger, 1988, Foundations for Financial Economics, Prentice Hall.  LeRoy, Stephen F. and Jan Werner, 2001，*Principles of Financial Economics*, Cambridge University Press, Cambridge, UK.  J. Campbell, A. Lo, A. MacKinlay, 1996, The Econometrics of Financial Markets, Princeton University Press.  D. Duffie, 2001, Dynamic Asset Pricing Theory 3rd edition, Princeton University Press.  J. Cochrane, 2001, Asset Pricing, Princeton University Press. | | |
| 备注 | 凡表格以上部分无法涵盖、教师认为需要说明的问题，请在此列出。 | | |

\*新开设课程可不填写课程编码，同意开设后由教学秘书编码并填入本表。

**注：凡授课对象含海外学生的课程必须同时提供本表中所有内容的英文版本。**