

## 《金融市场与金融工具》

英文课程名称: Financial Markets and Tools

任课教师: 金融市场与金融工具课程组

课程编号:

授课语言: 中文

授课对象:

课内学时: 36

课外学时:

**先修课程:**

人数要求: 少于 50 人

授课日期:

学 分:

### 一、教师简介与联系方式

#### 马卫锋

管理学博士、博士后，同济大学经济与管理学院副教授、硕士生导师，同济大学上海期货研究院院长助理，上海市金融学会会员。长期从事经济学、投资学及衍生品市场等领域的教学与科研工作。主持或参加国家自然科学基金、国家社会科学基金、科技部国家软科学基金、陆家嘴金融贸易区管理委员会等多项纵向课题的研究，以及中国期货业协会、上海期货交易所等部门委托的多项横向课题的研究。

电话: 021-65982274

Email: ma.wf@tongji.edu.cn

#### 孙丽华

2002-2010 年期间，先后就读于北京大学金融数学系、香港科技大学工业工程与物流管理系，分别获理学学士，工学博士学位。2010 年进入同济大学任教。研究方向为金融衍生品定价，金融风险管理和蒙特卡罗模拟。主持了国家自然科学基金项目：用方差减小法估计协方差矩阵可变时投资组合的 VAR 和 CVAR。

电话: 021-65982274

Email: sunlihua@tongji.edu.cn

#### 李海英

经济学博士，现从事金融学与证券投资学的教学、科研工作。入选同济大学青年优秀人

人才培养行动计划；主持并参与了浦东金融服务办系列课题、国家自然科学基金项目、科技部国家软科学课题等 10 余项纵向与横向课题的研究；已经在国内核心期刊、报纸上发表论文二十余篇；主要讲授《金融市场学》、《证券投资学》、《西方经济学》、《高级金融学》等课程；并作为同济大学上海期货学院研究员参与“期货师”的教学工作。

电话: 021-65982274

Email: haiying.li@tongji.edu.cn

## 二、课程概述

金融市场与金融工具与已经渗透到了现代生活的方方面面，不了解金融市场与金融工具已经很难理解现代经济的运行。本课程主要学习和讨论股票市场、货币市场、债券市场、期货市场、期权市场的运行机理及相关工具在投资、风险管理方面的运用。本课程将结合具体案例介绍和讨论金融市场的基本原理，金融工具的运用及策略。

## 三、教学的目标及要求

课程的基本目标是帮助学生建立对金融市场的认知，帮助其理解金融市场的运行原理并把握运用金融工具的方法。通过课程的学习，使学生在理解金融市场在现代经济中的作用的基础上，掌握金融市场的运行机理，了解金融市场的最新发展，了解各种金融工具，掌握金融工具在投资中的运用及其策略。通过本课程的学习，学生能够具备从业或进一步研究的理论知识基础与基本技能。

## 四、课程的主要内容及安排

课程名称		期货与期权	总教时数	36
单元	学时	内 容	课前阅读材料 (章节内容)	案 例
1	4	<b>金融市场、证券市场概述</b> 金融市场体系、股票市场、基金市场基本情况	教材[1]第 1 章	IPO 案例
2	4	<b>期货市场及其工具概述</b> 期货合约、期货交易制度	教材[1]第 13 章	3.27 国债期货事件
3	4	<b>期货市场的价格分析</b> 无套利均衡分析、持有成本理	教材[1]第 13 章	

		论		
4	4	<b>期货市场及其工具的运用</b> 期货套期保值策略与套利策略	教材[1]第 13 章	德国金属股份公司 (Metallgesellschaft AG) 事件、长期资本管理公司 (LTCM) 事件 点价交易 (basis trading)
5	4	<b>货币市场、债券市场及其工具</b> 利率、利率期限结构、货币市场、债券市场及债券估价	教材[1]第 2-3、6-7 章	LIBOR 丑闻
6	4	<b>债券市场及固定收益分析</b> 债券定价、抵押证券、债券衍生品	教材[1]第 8-9、15 章	次贷危机
7	4	<b>期权原理与策略</b> 期权市场运行机理、期权定价、期权交易策略、期权投资策略、B-S、二叉树	教材[1]第 14 章	巴林银行事件
8	4	<b>外汇及外汇市场</b> 外汇市场概述、汇率、外汇衍生品市场	教材[1]第 16 章	
9	4	<b>复习与考试</b>		

## 五、教学方法及手段

以课堂多媒体授课为主，部分内容特别是案例分析采用小组讨论方式，并结合个人与团队课题作业、模拟交易。

## 六、预期学习结果

类别	学习结果
知识掌握	<ul style="list-style-type: none"> <li>• 深入理解金融市场及其工具的相关概念、原理</li> <li>• 掌握金融市场分析的基本面分析和技术分析法</li> <li>• 掌握金融工具的交易原理与策略</li> <li>• 熟悉金融工具在投资管理方面的运用方法</li> </ul>
智力技能习得	<ul style="list-style-type: none"> <li>• 训练和培养逻辑思考能力</li> <li>• 培养以国际化视野理解和分析经济问题的能力</li> <li>• 提高理解、分析复杂金融市场与工具的能力</li> </ul>



实践技能习得	<ul style="list-style-type: none"> <li>提高学习能力和交流沟通的能力</li> <li>通过模拟金融交易提高交易操作能力</li> <li>提高发现问题、分析问题及解决问题的能力</li> </ul>
个人素质与人格塑造	<ul style="list-style-type: none"> <li>拓展国际化视野</li> <li>培养沟通协调及应对金融风险的能力</li> <li>培养责任意识和职业道德</li> </ul>

## 七、成绩测评方式

测评方式	比重 (%)	与预期学习结果结合情况
小组与个人作业	25	考察应用金融市场的知识和原理分析和解决实际问题的能力
课堂参与度	25	考察对股票、债券、期货等金融工具等相关知识的理解和应用能力，以及团队参与和有效沟通能力
考试	50	考查股票市场、债券市场、外汇市场、期货市场、期权市场及相应工具等模块的基本概念、重要理论等掌握程度

## 八、课程教科书、参考书目及指定阅读材料

### 1. 核心教材

[1] 杰夫·马杜拉(Jeff Madura). 金融市场与金融机构(原书第8版).机械工业出版社, 2010年

### 2. 参考书目

[1] 李心丹. 金融市场与金融机构. 中国人民大学出版社, 2013年