

北京大学汇丰商学院金融务实课程大纲

(2018-2019 学年 第二学期)

课程编号： 开课学期：2019 春季 总学时：36 学分：3

课程名称：现代金融市场前沿与实践（FICC 方向）

英文名称：Practical Perspectives on Global Markets Frontier

教学方式：案例教学+模拟交易 考试方式：项目作业+课堂讨论

先修要求：修读过固定收益证券和投资类相关课程，对金融市场、固定收益类金融工具以及金融机构有基础性了解。

主讲教师：巴曙松、朱晓天、孟小宁

辅助教师：

学科领域：固定收益、外汇、商品市场(FICC)与金融实务

选课人数：上限 100 人

上课时间：2019 年春季学期每周二晚 7-10 点

（除第 11 周课程安排在周一晚，第 12 周课程安排在周日及周一进行）

成绩评定方法：

- 1、课程考勤 20 分；
- 2、项目作业 60 分(30 分课堂作业+30 分模拟交易测验)；
- 3、小组讨论 20 分。

大纲内容简介：

本课程共 36 学时，分为 3 个教学模块，涵盖固定收益、外汇与商品（FICC）金融市场、金融工具的实践与分析，以及对现代金融行业、

机构、岗位的剖析与展望。

第一个模块聚焦金融市场和金融工具，分别涵盖固定收益、外汇和商品三个类别的市场运行、分析框架、定价原理和交易策略。课程以交易员的视角分析市场，研判各类资产的价格走势，量化引致价格变化的产品参数，从而形成一套以交易实操为核心的分析、量化和操作的体系。

第二个模块聚焦上机模拟和交易实操，包括用真实市场数据生成利率曲线模型，并回测产品净现值以及制定交易策略，以及外汇交易的市场仿真和交易盘模拟。

第三个模块聚焦金融机构与职业发展，更全面真实的聆听来自金融机构一线专家的职业生涯与感悟。

大纲详细内容：

第1周（2月19日）：金融务实课程概述（主讲：巴曙松等）

第2周（2月26日）：固定收益市场与交易（上）（主讲：孟小宁）

第3周（3月5日）：固定收益市场与交易（下）（主讲：孟小宁）

第4周（3月12日）：固定收益策略分析（主讲：昌明）

第5周（3月19日）：利率曲线建模辅导*（主讲：昌明）

第6周（3月26日）：利率和大类资产配置（上）（主讲：徐小庆）

第7周（4月2日）：利率和大类资产配置（下）（主讲：徐小庆）

第8周（4月9日）：中国债券市场开放与互联互通*（主讲：周兆平）

第9周（4月16日）：外汇市场与交易（上）（主讲：孙晓凡）

第10周（4月23日）：外汇市场与交易（下）（主讲：孙晓凡）

第11周（5月6日）：外汇市场模拟交易辅导（上）

第12周（5月12日）：外汇市场模拟交易辅导（中）

第12周（5月13日）：外汇市场模拟交易辅导及测验（下）

第13周（5月21日）：内地和香港证券执法机制与实践*（主讲：李佩霞）

第14周（5月28日）：课程作业演示和总结（主讲：朱晓天）

*为非必修课

教材：

1、The Hand Book of Fixed Income Securities, by Frank J. Fabozzi and Steven V. Mann

2、Options, Futures, And Other Derivatives, by John C. Hull

参考资料：

1、金融读书会， bashusongonfinance 微信公众号

2、陈志武金融通识课，陈志武著

3、复旦名师团的经济学课，喜马拉雅 FM

4、熊猫交易员笔记， FICCGEEK 微信公众号