

序号	专业方向	课程名称	简介
1	高级金融市场与交易管理	金融衍生品和金融工程	本课程采用模拟交易、案例研究和课堂讲授及讨论相结合的方式授课。课程将覆盖远期、期货、互换、期权等金融衍生产品的基本知识和主要应用。学生需要将所学内容用于设计投机、套利、套期保值方案，尤其是对主要市场风险（商品价格、利率、汇率、股票价格）能够应用衍生产品进行针对性管理。学生需要深刻领悟衍生产品对金融体系的重要性，理解负责任的意义。
2	高级金融市场与交易管理	思辨、生活和阿尔法证券组合管理实务	本课程是将投资学经典理论和资本市场实际情况相结合，帮助学生从全球视野建立科学投资观的课程。本课程主要围绕三个主题：理想市场和实际市场的差异、确定性因子的选择、证券组合实务。结合全球资本市场的最新变化，使学生在掌握与投资相关的基本理论的同时，了解全球资本市场和资产管理行业的最新发展动向。通过结合境内和境外资本市场不同的环境特点、经济运行规律、投资者个人特质，帮助学生们思考和建立行之有效并且符合自身能力的投资策略。
3	高级金融市场与交易管理	风险控制	本课程旨在介绍金融风险控制与分析的数量化方面。主要内容有：1) 金融风险案例、2) 金融经济学理论概述、3) 数理统计与经济计量概述、4) 风险价值方法VaR及其扩展、5) 连结函数Copula方法、6) 极值理论方法、7) 保险及金融业应用、8) 整体风险理论形式化体系。
4	高级金融市场与交易管理	国际金融管理	国际金融管理这门课程，从本质上讲，是研究的是货币政策的汇率传导机制。在利率市场化的环境下，汇率的波动变成常态，政府、企业、金融机构和个人在开放经济环境下必然面临更多的汇率风险，要求金融市场和金融机构提供更多的产品和服务，帮助不同的主体规避汇率风险。本课程的具体目的是：第一，先分析国际金融环境，之后，从国际收支的角度来看我国监管部门的外汇管理政策、国家主权财富基金如何运作外汇储备。第二，从理论上分析汇率的决定基础及影响因素。第三，度量和分析汇率风险及其表现形式；第四，阐述管理汇率风险的策略，涉及到远期外汇市场、货币市场、期货和期权市场、金融互换市场的运作等。第五，研究企业的跨国投资和融资策略等。
5	高级金融市场与交易管理	金融博弈	通过学习《金融博弈论》这门课程的学习，使学生能够掌握博弈论中各种均衡概念，以及其在经济及金融各领域的应用，加深对人与社会的认识，理解法律体系、道德、文化、创造力、企业家精神等对社会组织和经济的影响，掌握博弈论与诚信社会、和谐社会、百年老店之间的关系。在教学方法上，本课程尽量避免抽象的数理推导，而是注重与实际经济问题的联系，通过简明生动的案例，以及一些实证文献中研究结果，开阔同学们的思维，帮助他们理解掌握博弈论分析中的方法思路，认识到博弈论的局限性和适用范围，以及在实际应用中可能遇到的问题。
6	高级金融市场与交易管理	货币理论与货币政策	本课程主要介绍现代货币经济学中的基本理论及其应用，内容可以分为货币理论和货币政策及中国的货币政策问题三个部分。货币理论部分：1、货币发行与物价关系；2、货币与经济增长关系；3、货币与波动关系；4、通货膨胀及其福利成本；5、恶性通货膨胀问题；6、最优货币数量问题；7、开放经济中的货币问题。货币政策部分：1、货币政策的分析框架；2、货币政策的规则设计；3、开放经济中的货币政策问题
7	数智时代的金融科技	价值评估与投资决策	在企业的财务管理，特别是投资活动中，始终存在很大的不确定性。这些不确定性对于企业来说既是风险，同时又是机会。如何对这些投资机会的价值进行科学合理的评价，为企业的投资决策提供重要的依据，是企业的财务主管面临的重要课题之一。而在这方面，实物期权往往比传统的投资评估方法更具有威力。本课程旨在通过risk simulator及案例分析使学生掌握存在不确定性的环境中企业如何运用实物期权对其投资机会进行合理评价的基本方法，学会准确地把握投资时机，提升企业价值。课程首先介绍期权的各种评价方法，然后，通过案例分析，介绍实物期权在企业投资决策中的应用。
8	数智时代的金融科技	Python金融大数据分析	随着大数据时代的到来，人工智能等前沿的科技在算法深刻改变了金融业态，并成为未来金融发展的制高点。金融科技正在传统金融行业的各个领域积极布局，已然成为新的风口。本课程将介绍如何使用python对金融大数据进行分析。帮助零基础的同学，快速有效的掌握在金融领域需要用到的编程技术，并能够运用到实际当中解决问题。
9	数智时代的金融科技	监管科技	新技术的发展与运用在快速地改变着金融体系的结构与形式，金融科技已经成为推动金融产品与服务创新的重要因素。与此同时，与创新如影随形的是风险，金融科技的创新既有可能让金融机构与投资者承担新的、过度的风险，也有可能对金融体系带来新的潜在的系统性风险的冲击。我们需要在新的现实背景下，深入考察、分析和思考原有的金融风险管理、金融监管的制度框架、原则和方法是否还能够发挥其应有的作用，从而能够在金融科技创新与风险控制之间取得新的平衡。因此，本课程将采取双师同堂等多种形式，既向大家介绍金融科技的最新发展，也和大家一起学习并讨论金融风险管理、监管的原则与方法。
10	数智时代的金融科技	金融科技导论（金融科技前沿与案例分析）	近代的经济进步与金融创新紧密相连，而金融创新又与科技进步息息相关。以计算机和互联网技术为代表的信息革命，创造出由科技驱动的金融创新——金融科技（FinTech）。我们正在从金融科技1.0阶段快速迈入以云计算、大数据、区块链和人工智能等驱动的金融科技2.0阶段，不断有更多资金、人才、产业被卷入金融科技大潮。本课程从实战经验出发，讲述金融科技的内涵与外延，并剖析大数据、区块链和人工智能技术在金融业的运用案例。
11	数智时代的金融科技	大数据建模与金融市场	本课程结合大数据与计量统计模型，力图贴近现实，运用这些技术和方法对金融市场进行实证分析，并辅助投资者和企业高管进行战略决策制定。在保证理论介绍和阐述的完整性的前提下，借助金融实验室，通过对 Stata 计量软件的操作的讲解，借助于相关的案例与数据，培养学生对数据的处理和量化分析能力，从而加深对于金融市场及宏观经济环境相关规律的理解，并起到辅助学生进行投资和企业决策的目标。相比于传统的量化学科教学，本课程将以金融及企业决策作为场景来对学生进行讲解，从而使学生得以掌握一些更为贴近现实的问题的数据和模型，并对其毕业论文的写作起到指导作用。
12	数智时代的金融科技	人工智能和量化投资	随着云时代的到来，人工智能技术将具有越来越重要的战略意义。人工智能已经渗透到了每一个行业和业务领域，逐渐成为重要的生产要素。量化投资在国外的的发展已非常成熟，与此相反，曾经在相当长的一段时间里，国内量化投资领域发展缓慢。十二届全国人大会议上，李克强总理在《2017年政府工作报告》中首次提及“人工智能”和数字经济。运用专业的人工智能和量化分析方法到投资业务中，是未来量化投资分析师的职业能力诉求。本课程涵盖内容广泛，提供Python语言编程基础、金融知识基础、人工智能技术基础和量化投资多平台模拟交易四个模块的教学。主要包括：人工智能和量化投资简介、Python语言简介与爬虫、基于Python的金融大数据实战、基于Python的金融大数据实战1、基于Python的金融大数据实战2、机器学习和深度学习简介、大数据、机器学习和量化投资等。此外本课程还包括了还包括基于优矿平台实盘交易，为学子打开人工智能和量化投资的大门。

此文件版权归上海财经大学商学院及任课教师所有，未经授权，不得转载
授课老师有权根据选课学生背景针对课程内容调整