

2022 年秋季学期《固定收益证券实务》课程介绍

《固定收益证券实务》是数学科学学院于 2021 年秋季学期首次开设的面向金融硕士和高年级本科生的金融实务课程。本课程将主要围绕我国固定收益证券业务的实务展开讲授，邀请众多业界校友和专业人士就固定收益证券实务中的基本问题与解决方案进行讲解，分享他们在固定收益证券领域的实践经验。

随着我国固定收益市场的产品种类不断增多、规模不断提升，金融业界对固定收益证券的人才需求也日益增长。本课程将邀请众多业界嘉宾从不同角度全方位介绍我国固定收益证券市场。

通过学习本课程，同学们可以在夯实基础理论知识的同时，对我国固定收益市场有更为系统、更加感性的认识，对业界的固定收益实务有更为深入的了解，提升在就业时的竞争力。

本课程适合于有一定的金融基础知识的学生，课程将帮助有志于今后从事与固定收益证券相关的理论研究和实际工作的学生开阔视野、提升认知和锻炼能力。

欢迎同学们选修本课程！

课程基本信息：

课程名：固定收益证券实务

课程号：00102872

学分：2 学分

上课时间：1-16 周，每周六 7-8 节，第一次课：9 月 17 日

上课地点：二教 315

面向学生：数学科学学院、光华管理学院和经济学院“金融硕士”研究生、部分高年级本科生及博士研究生。选课学生应当对现金流等金融基本概念已有初步了解。

本课程包括三个主要部分：

1. 固定收益证券理论基础。主要由校内教师讲授，讲解固定收益证券的基础知识、利率模型、信用模型等。
2. 固定收益证券实践基础。由业界嘉宾讲授，内容将涉及实务中的宏观经济分析、利率分析、信用分析方法等。
3. 固定收益市场机构专题。由业界嘉宾讲授，邀请来自券商、银行、保险、基金等各类市场机构的专家介绍我国固定收益市场行业现状。

附 课程大纲（暂定）

	课次	课程内容	授课老师（拟任）
	1	课程简介和我国固定收益证券概貌	吴岚（北京大学） 金志刚（泰康资管）
固定收益证券理论基础	2	固定收益证券理论基础	吴岚
	3	利率期限结构模型和建模	
	4	随机利率模型和建模	
	5	信用模型（个体、组合）和建模	
	6	利率和信用衍生品模型	
固定收益证券实践基础	7	宏观经济和大类资产配置周期、框架	王汉峰（中金公司）
	8	利率分析框架	徐高（中银国际）
	9	利率债和利率衍生品	许辉（工银理财）
	10	信用分析和投资	黄德龙（中信证券）
	11	可转债和固收+	吕占甲（交银理财）
	12	资产证券化	待定
固定收益市场机构专题	13	一级市场承销发行和销售交易	陈智罡（中信证券）
		券商自营和资产管理	安安（中金公司）
	14	银行自营和理财	待定
		保险资产管理	许博（中国人寿）
	15	公募基金及专户	于善辉（民生加银基金）
		私募基金	李蓓（半夏投资）