

《金融实证分析方法》教学大纲

课程名称：金融实证分析方法	课程类别（必修/选修）：必修
课程英文名称：EMPIRICAL METHODS IN FINANCE RESEARCH	
总学时/周学时/学分：48/3/3	其中实验/实践学时：32
先修课程：财务管理、投资学、机率论与数理统计、统计学 1	
后续课程支撑：毕业专题、毕业设计	
授课时间：周五/1-3 节	授课地点：实验楼 313
授课对象：2019 经济与金融专业	
开课学院：粤台产业科技学院	
任课教师姓名/职称：谢松霖/副教授	
答疑时间、地点与方式：周三整天，实验楼 203 或线上，个别答疑讨论	
课程考核方式：开卷（ <input type="checkbox"/> ）闭卷（ <input type="checkbox"/> ）课程论文（ <input type="checkbox"/> ）其它（ <input checked="" type="checkbox"/> ）	
<p>使用教材：</p> <p>1. 计量经济分析（上下册），第六版，威廉.H. 格林, 张成思，中国人民大学出版社</p> <p>2. 计量经济学导论（上下册），第六版，杰弗里.M. 伍德里奇，中国人民大学出版社</p> <p>3. 自编讲义</p> <p>参考文献</p> <p>1 投资学，第 10 版，（美）滋维. 博迪等，机械工业出版社</p> <p>2 风险管理，第三版，(加)约翰 C. 赫尔，机械工业出版社。</p>	
<p>课程简介：本课程教学，以习近平中共中央总书记、国家主席、中央军委主席习近平总书记新时代中国特色社会主义经济思想指导，研究经济与金融议题为核心，培养经济与金融领域研究能力，包含经济与金融领域模型应用，文献寻找与阅读，数据库数据取得与运用，数据分析方法，计量与统计模型应用，论文撰写。</p>	
课程教学目标及对毕业要求指标点的支撑：	

课程教学目标	支撑毕业要求指标点	毕业要求
目标 1: 培养学生具备经济与金融领域研究之文献理解能力（理解）。	透过重要的文献阅读，掌握经济与金融议题的重要概念、能够将所学知识用于解决经济与金融领域的复杂问题	B3 经济管理知识 了解企业管理、市场营销、经济运作、经济政策、投资理财等方面的基本知识；掌握金融产业服务、运行、营销、管理方面的经济管理知识。
目标 2: 培养经济与金融领域研究方法应用能力（综合）	能够针对经济与金融领域的问题进行有系统的分析与解决，有能力根据不同状况，运用社会科学之统计与推论工具，选择最佳解决途径与寻求背后之经济与金融意涵	B4 工具性知识 掌握现代文献资料检索、查询的方法，具备信息检索的技能；掌握云端运算、金融大数据分析、财金资料库检索与分析方面的知识。
目标 3: 培养学生经济与金融领域研究撰写能力（综合）	具有综合应用知识能力和实践能力，能把学到的经济学和金融学知识运用经济与金融领域研究与解答问题，成为金融业高素质复合型专业金融精英人才	C2 运用专业知识的能力 具有良好的综合应用知识能力和实践能力，能把学到的经济学和金融学知识运用于实践。

理论教学进程表

周次	教学主题	授课教师	学时数	教学内容（重点、难点、课程思政融入点）	教学模式 (线上/混合式/线下)	教学方法	作业安排	支撑课程目标

1	金融实证研究方法介绍、基础回归模型应用与相关文献导读	谢松霖	3	<p>重点：金融实证研究方法介绍与相关文献导读、基础回归模型应用</p> <p>难点：关文献理解、统计软件操作、统计图表解读</p> <p>课程思政融入点：了解习近平总书记新时代中国特色社会主义思想，于金融发展与研究方向上的影响与前景</p>	混合式：线上，使用优学院与超星、配合腾讯会议			目标 1
2	论文写作介绍与任务说明与相关文献导读	谢松霖	3	<p>重点：论文结构解析与论文写作任务，</p> <p>难点：研究方向与论文题目选取</p>	混合式：线上，使用优学院与超星、配合腾讯会议	课堂讲授和小组讨论		目标 1
3	图书馆资源与研究过程相关在线资源的使用与相关文献导读	谢松霖	3	<p>重点：使用学校已购买数据库，运用于论文之文献搜集、文献整理、外文文献寻找，金融与经济相关大数据库介绍</p> <p>难点：学术搜寻关键词掌握能力，外文文献阅读能力，文献质量判断能力，数据定义不熟悉</p> <p>课程思政融入点：运用图书馆资源，培养信息搜集能力，帮助认识社会发展与最新研究与科技进步概况，并鉴往知来。</p>	混合式：线上，使用优学院与超星、配合腾讯会议	课堂讲授和小组讨论		目标 1

4	论文统计与计量方法、论文图表制作应用与相关文献导读	谢松霖	3	重点: 论文统计与计量方法、论文图表制作应用 难点: 统计软件操作、图像处理	混合式: 线上, 使用优学院与超星、配合腾讯会议	课堂讲授和小组讨论		目标 2
5	经济与金融资料库数据的使用方法、经典文献导读、线上资源说明与相关文献导读	谢松霖	3	重点: 经济与金融资料库数据的使用方法、经典文献导读、对应金融数据库使用 难点: 文献理解 课程思政融入点: 藉由经典文献导读, 加深了解习近平总书记新时代中国特色社会主义思想	混合式: 线上, 使用优学院与超星、配合腾讯会议	课堂讲授和小组讨论	课后作业 1 经济与金融研究方向之文献检索与整理	目标 2
6	经济与金融资料处理要点, 以资本资产定价模型因子估算讲解与示范与相关文献导读	谢松霖	3	重点: 经济与金融资料处理要点, 以资本资产定价模型因子估算讲解与示范, FAMA 三因子模型讲解 难点: 资料处理与因子估算需要熟悉编程, 对数据定义与性质需熟悉	混合式: 线上, 使用优学院与超星、配合腾讯会议	课堂讲授和小组讨论		目标 2
7	当前经济与金融研究发展分析与讨论与相关文献导读	谢松霖	3	重点: 当前经济与金融研究发展分析与讨论, 文献与研究模型导读 难点: 研究模型理解 课程思政融入点: 分析当前经济与金融研究发展, 了解习近平总书记新时代中	混合式: 线上, 使用优学院与超星、配合腾讯会议	课堂讲授和小组讨论		目标 1

				国特色社会主义思想，于金融发展与研究方向上的影响与前景				
8	文献综述与开题报告、任务书的详细说明与写作与相关文献导读	谢松霖	3	重点：文献综述与开题报告、任务书写作要点详细说明 难点：文献综述、开题报告与任务书实际写作 课程思政融入点：导读经济与金融研究最新发展文献，结合习近平总书记新时代中国特色社会主义思想，探讨于金融发展与研究方向上的影响与前景	混合式：线下或使用优学院与超星、配合腾讯会议	课堂讲授和小组讨论		目标 3
9	写作指引与论文答疑，实际论文写作练习与相关文献导读	谢松霖	3	重点：个人论文写作指引与答疑 难点：实际论文写作练习	混合式：线下或使用优学院与超星、配合腾讯会议	课堂讲授和小组讨论		目标 3
10	基础时间序列模型应用与相关文献导读	谢松霖	3	重点：时间序列模型应用与相关文献导读 难点：数据处理程序、统计软件操作、统计图表解读	混合式：线下或使用优学院与超星、配合腾讯会议	课堂讲授和小组讨论		目标 3
11	面板数据模型应用与相关文献导读	谢松霖	3	重点：面板数据模型应用与相关文献导读 难点：数据处理程序、统计软件操作、统计图表解读	混合式：线下或使用优学院与超星、配合腾讯会议	课堂讲授和小组讨论		目标 2

12	Logistic and Probit 模型应用与相关文献导读	谢松霖	3	重点: Logistic and Probit 模型应用与相关文献导读 难点: 数据处理程序、统计软件操作、统计图表解读	混合式: 线下或使用优学院与超星、配合腾讯会议	课堂讲授和小组讨		目标 2
13	VAR 模型应用与相关文献导读	谢松霖	3	重点: VAR 模型应用与相关文献导读 难点: 数据处理程序、统计软件操作、统计图表解读	混合式: 线下或使用优学院与超星、配合腾讯会议	课堂讲授和小组讨	课后作业 2 经济与金融研究工具与方法之文献检索与整理	目标 2
14	课程进度调整、个人论文研究方向与可行性分析与指导	谢松霖	3	重点: 个人论文研究方向对应经济与金融数据取得、相关文献导读与可行性分析与指导 难点: 研究变量定义, 研究数据取得	混合式: 线下或使用优学院与超星、配合腾讯会议	课堂讲授和小组讨		目标 3
15	课程进度调整、论文研究方法分析与指导(I)	谢松霖	3	重点: 个人论文统计与计量方法分析与指导, 难点: 研究变量确定、数据整理方法	混合式: 线下或使用优学院与超星、配合腾讯会议	课堂讲授和小组讨		目标 3
16	课程进度调整、论文研究方法分析与指导(II)	谢松霖	3	重点: 个人论文研究对应经济与金融模型研究假设、适合性检验 难点: 研究数据再处理以符合采用模型之适合性检定	混合式: 线下或使用优学院与超星、配合腾讯会议	课堂讲授和小组讨		目标 3
合计			48					

实践教学进程表

周次	实验项目名称	授课教师	学时	教学内容（重点、难点、课程思政融入点）	项目类型（验证/综合/设计）	教学方式	支撑课程目标
4	论文统计与计量方法、论文图表制作应用与相关文献导读	谢松霖	3	重点：论文统计与计量方法、论文图表制作应用 难点：统计软件操作、图像处理	综合	课堂讲授和小组讨	目标 2
5	经济与金融资料库数据的使用方法、经典文献导读、线上资源说明与相关文献导读	谢松霖	3	重点：经济与金融资料库数据的使用方法、经典文献导读、对应金融数据库使用 难点：文献	综合	课堂讲授和小组讨	目标 2
6	经济与金融资料处理要点，以资本资产定价模型因子估算讲解与示范与相关文献导读	谢松霖	3	重点：经济与金融资料处理要点，以资本资产定价模型因子估算讲解与示范，FAMA 三因子模型讲解 难点：资料处理与因子估算需要熟悉编程，对数据定义与性质需熟悉	综合	课堂讲授和小组讨	目标 2
7	当前经济与金融研究发展分析与讨论与相关文献导读	谢松霖	3	重点：当前经济与金融研究发展分析与讨论，文献与研究模型导读 难点：研究模型理解	综合	课堂讲授和小组讨	目标 1

8	文献综述与开题报告、任务书的详细说明与写作与相关文献导读	谢松霖	3	重点：文献综述与开题报告、任务书写作要点 详细说明 难点：文献综述、开题报告与任务书实际写作	综合	课堂讲授和小组讨	目标 3
9	写作指引与论文答疑，实际论文写作练习与相关文献导读	谢松霖	3	重点：个人论文写作指引与答疑 难点：实际论文写作练习	综合	课堂讲授和小组讨	目标 3
10	基础时间序列模型应用与相关文献导读	谢松霖	3	重点：时间序列模型应用与相关文献导读 难点：数据处理程序、统计软件操作、统计图表解读	综合	课堂讲授和小组讨	目标 3
11	面板数据模型应用与相关文献导读	谢松霖	3	重点：面板数据模型应用与相关文献导读 难点：数据处理程序、统计软件操作、统计图表解读	综合	课堂讲授和小组讨	目标 2
12	Logistic and Probit 模型应用与相关文献导读	谢松霖	3	重点：Logistic and Probit 模型应用与相关文献导读 难点：数据处理程序、统计软件操作、统计图表解读	综合	课堂讲授和小组讨	目标 2
13	VAR 模型应用与相关文献导读	谢松霖	3	重点：VAR 模型应用与相关文献导读 难点：数据处理程序、统计软件操作、统计图表解读	综合	课堂讲授和小组讨	目标 2

14	个人论文研究方向与可行性分析与指导	谢松霖	2	重点：个人论文研究方向对应经济与金融数据取得、相关文献导读与可行性分析与指导 难点：研究变量定义，研究数据取得	综合	课堂讲授和小组讨	目标 3
合计			32				

课程考核

课程目标	支撑毕业要求指标点	评价依据及成绩比例（%）				
		课堂表现与出席	作业	期末考核 期末报告演示		
目标 1	B3	20	20	20		
目标 2	B4	0	10	10		
目标 3	C2	0	10	10		
总计		20	40	40		100

备注：[1\) 根据《东莞理工学院考试管理规定》第十二条规定：旷课 3 次（或 6 课时）学生不得参加该课程的期终考核。](#)[2\) 各项考核标准见附件所示。](#)

大纲编写时间：2020 年 9 月 4 日

系（部）审查意见：

系（部）主任签名：

黄灯奎

日期： 年 月 日

备注：

附录：评分标准表

作业评分标准

观测点	评分标准			
	<i>A (100)</i>	<i>B (85)</i>	<i>C (70)</i>	<i>D (0)</i>
基本概念掌握程度	概念清楚，答题正确。	概念比较清楚，作业比较认真，答题比较正确。	概念基本清楚，答题基本正确。	概念不太清楚，答题错误较多。
解决问题的方案正确性	解题思路清晰，计算正确	概念比较清楚，作业比较认真，答题比较正确。	概念基本清楚，答题基本正确。	概念不太清楚，答题错误较多。
作业完成态度	按时完成，书写工整、清晰，符号、单位等按规范要求执行	按时完成，书写清晰，主要符号、单位按照规范执行	按时完成，书写较为一般，部分符号、单位按照规范执行	未交作业或后期补交，不能辨识，符号、单位等不按照规范执行