

金融工程学硕士研究生培养方案（0202Z1）

一、培养目标

本专业培养具有较高的政治思想素质，掌握科学的世界观和方法论，具备扎实的应用经济学理论功底和良好的数理分析技能，系统掌握金融工程专业的基本理论和基本方法，能够满足金融机构、政府部门和企事业单位需求，德智体美劳全面发展的高素质复合型人才。

二、基本要求

（一）获本专业硕士学位应掌握的基本知识

掌握应用经济学科的基础理论知识；掌握本专业基本理论与基本方法；掌握相关的数量分析工具和分析技能；能够使用各种常用的计算机软件，能阅读本专业的英文文献。

（二）获本专业硕士学位应具备的基本素质

1. 学术素养：具有从事本专业理论或实际工作的专业精神、才智、涵养和创新意识；具有严谨的逻辑思维能力，并能够将它应用到研究和工作领域；注重对研究规范和方法的掌握；了解本学科相关的知识产权、研究伦理等方面的知识，并能身体力行。

2. 学术道德：恪守学术道德规范，严守学术诚信；树立法制观念，保护知识产权，尊重他人的劳动权益；所有引用和参考都应该注明出处，尊重客观现象，不随意篡改研究数据。

（三）获本专业硕士学位应具备的基本学术能力

1. 获取知识的能力：应能利用现代信息技术，掌握中、英文文献的检索和查询技巧，了解本专业的发展历史和趋势。

2. 科学研究能力：应能基于金融实践和理论思考，提出本专业领域的重要研究问题，运用基本的研究方法和手段，对特定问题进行理论和逻辑分析，并得出有意义的结论。

3. 实践能力：应在学习过程中，积极参与社会实践活动，善于从现实中发现问题的，能够用理论指导实际行动，独立完成研究过程的各个必要环节，能够通过团队合作方式解决问题。

4. 学术交流能力：应能利用各种媒介、通信技术和信息手段，搜集信息，并对所掌握的信息进行有效的加工和处理，能够将自己的想法以清楚明白的方式表达和传递出去，善于倾听和采纳别人的意见，实现有效的交流。

5. 其他能力：要注重个性与全面发展，在学习与创新、知识与能力、理论与实践之间取得有效的平衡。

三、研究方向

1. 金融资产定价
2. 金融风险管理
3. 证券投资理论与实务
4. 公司金融

四、课程设置（见附表 1）

金融工程学术硕士学位的总学分为 38 学分，其中必修课 27 学分，选修课 6 学分，实践与创新培养 5 学分，毕业论文不计学分。课程设置与学分分配见附表 1。

五、实践与创新

学术学位硕士研究生满足以下条件之一可获得专业学术论文 2

学分：

(1) 在校期间发表 A2 及以上级论文记 5 学分，A3 级记 4 学分，B1 级记 3 学分。发表 B2 级刊物或者在国际会议上宣读论文（学分认定以会议邀请函为依据）记 2 学分。论文署名单位为山西财经大学。导师为第一作者，研究生本人为第二作者的学术论文按照研究生为第一作者计学分；第一作者为本校本学科教师，研究生本人为第二作者的学术论文按 1/2 比例折算记学分；以其他合作方式发表的学术论文只给第一作者研究生记学分；

(2) 参与 B2 级及以上项目，前 3 名，学分认定以立项书、结项报告书为依据；

(3) 获得省部级（含）以上和国家级学术会议级别的科研成果奖励，一等奖排名前 5 名，二等奖排名前 4 名，三等奖和其它奖排名前 3 名。

其它学分按照《山西财经大学学术学位硕士研究生培养管理办法》（晋财大校【2017】92 号）“第四章 实践与创新培养”要求执行。

六、学位（毕业）论文基本要求

1. 规范性要求：学位论文严格按照《山西财经大学研究生学位论文写作模板（2014 版）》写作。

2. 质量要求：论文选题应有明确的经济应用背景，论文工作应有一定的技术难度或理论深度，成果具有一定的理论性和实用性；文献综述应对选题所涉及的经济理论和实际问题，以及研究课题的国内外状况有清晰的描述与分析；正文应综合应用基础理论、经济学方法、金融工程专业知识和实证方法等对所解决的经济问题进行分析研究，

并能在某些方面提出一些新理论、新方法，或提出一些新见解、新观点，或具有新发现、新成果；论文写作要求概念清晰，结构合理，层次分明，文理通顺，版式规范；论文应体现出写作者受过系统的学术训练。

七、本专业主要参考书目（见附表 2）

附表 1:

金融工程硕士研究生课程设置表（学术学位）

课程类别	课程名称	学分	学时	开课学期	课程归属	学分分配	
必修课	公共基础课	中国特色社会主义理论与实践研究	2	32	1	马克思主义学院	8 学分
		马克思主义与社会科学方法论	1	16			
		外国语	4	64	1-2	经贸外语学院	
		尊重学术道德与遵守学术规范	1	18	1	研究生院	
	专业基础课	中级宏观经济学	3	48	1	研究生院	9 学分
		中级微观经济学	3	48		研究生院	
		中级计量经济学及相关研究方法	3	48		研究生院	
	专业课	金融经济学	2	32	2	金融学院	10 学分
		随机过程	2	32			
		金融理论与政策	2	32			
金融衍生产品定价		2	32				
金融风险管理		2	32				
选修课	专业方向选修课	公司金融	1	16	3	金融学院	2 学分
		投资学	1	16			
		金融科技	1	16			
		金融工程方法与技术	1	16			
	任意选修课	金融时间序列分析	1	16	1-3	金融学院	4 学分
		财务报表分析	1	16			
		能源金融	1	16			
		金融软件应用	1	16			
		Management of Financial Institutions	2	32			
		鼓励学生自主选修其它学科的方法论课程	4	64		其他学院	
实践与创新培养	学术论文 2 学分；科研项目 1 学分； 专业学术报告（可选），教学实践 1 学分；社会实践 1 学分。					5 学分	
总学分						38 学分	

附表 2:

金融工程硕士研究生主要阅读书目

序号	书名	著者	出版社	出版年	语种	要求
1	投资学	滋维·博迪	机械工业出版社	2017	中译本	必读
2	公司理财	斯蒂芬 A.罗斯	机械工业出版社	2017	中译本	必读
3	金融工程学	沈沛龙	中国金融出版社	2017	中文	必读
4	金融衍生品定价	刘维奇	高等教育出版社	2018	中文	必读
5	金融经济学	王江	中国人民大学出版社	2006	中文	必读
6	风险管理与金融机构	约翰赫尔	机械工业出版社	2018	中译本	必读
7	应用随机过程	张波	中国人民大学出版社	2016	中文	必读
8	期权、期货及其它衍生产品	约翰赫尔	机械工业出版社	2018	中译本	必读
9	行为金融:心理、决策和市场	阿科特迪弗斯	机械工业出版社	2012	中译本	选读
10	金融时间序列分析	蔡瑞胸	人民邮电出版社	2012	中译本	选读
11	行为金融学	饶育蕾	机械工业出版社	2018	中文	选读
12	资产定价理论	彭纳齐.	东北财经大学出版社	2009	中文	选读
13	金融数学:金融工程引论	马雷克, 托马斯.	中国人民大学出版社	2014	中译本	选读
14	金融学与经济学中的数值方法:基于 MATLAB 编程	保罗.	机械工业出版社	2017	中译本	选读
15	数理金融:资产定价与金融决策理论	叶中行.	科学出版社	2010	中文	选读
16	数理金融学与金融工程基础	张永林.	高等教育出版社	2011	中文	选读
17	公司财务原理	理查德 A.布雷利 / 斯图尔特 C.迈尔斯	机械工业出版社	2013	中译本	选读
18	非理性繁荣	罗伯特·希勒	中国人民大学出版社	2016	中译本	选读
19	漫步华尔街	伯顿·马尔基尔	机械工业出版社	2018	中译本	选读
20	聪明的投资者	本杰明·格雷厄姆	人民邮电出版社	2016	中译本	选读
21	债券市场:分析和策略	弗兰克 J.法博齐	机械工业出版社	2017	中译本	选读
22	证券分析	本杰明·格雷厄姆	中国人民大学出版社	2013	中译本	选读
23	现代证券分析	马丁 J.惠特曼	机械工业出版社	2015	中译本	选读
24	投资者的未来	杰里米 J.西	机械工业出版社	2018	中译本	选读

		格尔				
25	投资丛林：一位投资大师 跨越 50 年的私人手记	斯蒂芬·加里 斯洛夫斯基	中信出版社	2009	中译本	选读
26	股市趋势技术分析	罗伯特·D·爱 德华	中国发展出版社	2004	中译本	选读
27	帝纳波利点位交易法	乔尔·帝纳波 利	广东经济出版社	2010	中译本	选读
28	技术分析	马丁 J. 普林 格	机械工业出版社	2016	中译本	选读
29	海龟交易法则	美费思	中信出版社	2013	中译本	选读
30	乌合之众：大众心理研究	古斯塔夫·勒 庞	电子工业出版社	2016	中译本	选读