

## 金融专业学位硕士培养方案

### 一、培养目标

培养德智体全面发展、具备坚实的经济金融理论基础、了解国际金融业的前沿发展、能够将金融学、经济学、管理学、数量方法等知识和技能融会贯通、同时能够密切联系中国实践，胜任金融监管部门、各类金融机构工作的高层次应用型人才。

### 二、专业要求

1. 身心健康，具备良好的政治思想素质和职业道德素养。
2. 充分了解金融理论与实务，系统掌握投融资管理技能、金融交易技术与操作、金融产品设计与应用、财务报表分析、金融风险管理以及相关领域的知识和技能，具有较强的解决金融实际问题能力。
3. 较为熟练地掌握英语，能阅读本专业的英文资料，并能进行英文论文写作。
4. 熟悉现代信息技术，具备熟练运用网络查阅、收集和处理相关专业知识的技能，具备较强的写作能力和沟通能力。

### 三、研究方向

全日制金融硕士分为四个方向：

1. 银行管理
2. 资本市场
3. 金融工程
4. 量化投资

非全日制金融硕士不区分研究方向。

### 四、学习形式及学习年限

本专业的学习形式分为全日制和非全日制两种，基本学习年限为二年。在校生休复学、出国、延长学习年限等的具体申请办法见《对外经济贸易大学研究生学籍管理办法》。

### 五、学分要求

本专业课程分为必修课和选修课，研究生应在导师指导下制定个人培养计划、选择选修课。

1. 全日制金融硕士最低学分要求为 28 学分，其中：

(1) 普通全日制（含银行管理、资本市场、金融工程方向）：必修课 12 学分，选修课 12 学分（专业选修课不低于 6 学分），实践环节 4 学分。

要求普通全日制研究生在金融机构或政府及企事业单位的金融工作岗位累计实习时间不少于 6 个月。实习结束后须提交不少于 3000 字的实习报告和实习单位的实习鉴定，实习报告经专家评审合格且实习鉴定为合格。

(2) 量化投资方向全日制：必修课 5 学分，专业选修课 21 学分（从计算机与数理方法模块中选修不低于 5 学分、量化产品与投资策略模块中选修不低于 5 学分），实践环节 2 学分。

要求量化投资学生在业界指导下完成量化策略开发或量化课题，并提交量化投资策略或课题报告。

2. 非全日制金融硕士最低学分要求为 30 学分，其中，必修课 20 学分，选修课 10 学分。

研究生选课、课程考核、成绩评定、学分替代等严格按照《对外经济贸易大学研究生课程学习及成绩管理办法》及《对外经济贸易大学研究生学籍管理办法》的有关规定执行。

## 六、毕业条件与学位授予

1. 本专业硕士生应满足以下条件方可毕业：
  - (1) 已制定的个人培养计划合格；
  - (2) 已修满培养计划内规定的学分，且各课程成绩合格；
  - (3) 符合学校学籍及其它相关管理规定；
  - (4) 已通过毕业（学位）论文答辩。
2. 研究生毕业（学位）论文开题、写作、学术不端行为检测、外审、答辩等应严格参照我校研究生学位管理的有关规定执行。
3. 本专业授予金融硕士专业学位。

## 七、课程设置计划及专业阅读书目

## 金融专业学位硕士课程设置计划（普通全日制）

学院：金融学院

适用年级：2017

学科专业名称：金融

学科专业代码：025100

| <b>方案总要求</b>    |          | 总学分 不低于 28 学分   |               |      |    |    |      |    |  |
|-----------------|----------|-----------------|---------------|------|----|----|------|----|--|
| <b>公共课</b>      |          | 5 学分            |               |      |    |    |      |    |  |
| <b>基础课</b>      |          | 7 学分            |               |      |    |    |      |    |  |
| <b>必修环节</b>     |          | 4 学分            |               |      |    |    |      |    |  |
| <b>专业课</b>      |          | 总学分 不低于 6 学分    |               |      |    |    |      |    |  |
| <b>银行管理模块</b>   |          | 计入总学分           |               |      |    |    |      |    |  |
| <b>资本市场模块</b>   |          | 计入总学分           |               |      |    |    |      |    |  |
| <b>金融工程模块</b>   |          | 计入总学分           |               |      |    |    |      |    |  |
| <b>跨专业课与公选课</b> |          | 计入总学分           |               |      |    |    |      |    |  |
| 课程类别            | 课程编码     | 课程名称            | 是否必修          | 是否学位 | 学分 | 学时 | 开课学期 | 备注 |  |
| 公共课             | 02167001 | 金融英语            | 是             | 是    | 3  | 48 | 秋    |    |  |
|                 | 13005006 | 中国特色社会主义理论与实践研究 | 是             | 是    | 2  | 32 | 秋    |    |  |
| 基础课             | 02027001 | 应用经济分析          | 是             | 是    | 3  | 48 | 秋    |    |  |
|                 | 02037002 | 财务报表分析          | 是             | 是    | 2  | 32 | 秋    |    |  |
|                 | 02037003 | 宏观金融分析          | 是             | 是    | 2  | 32 | 秋    |    |  |
| 必修环节            | SJHJ7001 | 专业实习            | 是             | 否    | 4  |    |      |    |  |
| 专业课             | 银行管理模块   | 02025010        | 转型时期的中国宏观经济政策 | 否    | 否  | 1  | 16   | 春  |  |
|                 |          | 02035050        | 货币理论与货币政策分析   | 否    | 否  | 1  | 16   | 秋  |  |
|                 |          | 02035059        | 金融改革与开放专题     | 否    | 否  | 2  | 32   | 春  |  |
|                 |          | 02035061        | 宏观金融规划与政策     | 否    | 否  | 2  | 32   | 春  |  |
|                 |          | 02037004        | 国际金融管理        | 否    | 否  | 2  | 32   | 春  |  |
|                 |          | 02037009        | 金融与法          | 否    | 否  | 2  | 32   | 春  |  |
|                 |          | 02037030        | 银行营销          | 否    | 否  | 1  | 16   | 秋  |  |
|                 |          | 02037033        | 小企业金融实务       | 否    | 否  | 2  | 32   | 春  |  |
|                 |          | 02037038        | 银行报表分析        | 否    | 否  | 2  | 32   | 秋  |  |
|                 | 资本市场模块   | 02037042        | 金融监管          | 否    | 否  | 2  | 32   | 春  |  |
|                 |          | 02035012        | 投资组合管理        | 否    | 否  | 1  | 16   | 秋  |  |
|                 |          | 02035023        | 租赁与信托         | 否    | 否  | 1  | 16   | 春  |  |
|                 |          | 02035024        | 房地产金融         | 否    | 否  | 1  | 16   | 春  |  |
|                 |          | 02035027        | 私募股权与风险投资     | 否    | 否  | 1  | 16   | 春  |  |
|                 |          | 02035055        | 固定收益分析与量化策略   | 否    | 否  | 2  | 32   | 春  |  |
|                 |          | 02035056        | 高频交易与对冲套利     | 否    | 否  | 2  | 32   | 春  |  |
|                 |          | 02035062        | 投资银行专题        | 否    | 否  | 2  | 32   | 秋  |  |
|                 |          | 02037005        | 投资学           | 否    | 否  | 2  | 32   | 秋  |  |
|                 |          | 02037007        | 公司金融          | 否    | 否  | 2  | 32   | 秋  |  |
| 02037028        | 税收筹划     | 否               | 否             | 1    | 16 | 春  |      |    |  |
| 02037031        | 项目融资     | 否               | 否             | 1    | 16 | 秋  |      |    |  |

金融学院研究生培养方案

|          |          |                  |   |   |    |    |   |  |
|----------|----------|------------------|---|---|----|----|---|--|
| 金融工程模块   | 02037032 | 投资分析与交易技术        | 否 | 否 | 2  | 32 | 秋 |  |
|          | 02037037 | 兼并与收购            | 否 | 否 | 1  | 16 | 春 |  |
|          | 02037049 | 财富管理             | 否 | 否 | 2  | 32 | 秋 |  |
|          | 02037057 | 金融市场与机构          | 否 | 否 | 2  | 32 | 秋 |  |
|          | 02027002 | 计量经济软件及应用        | 否 | 否 | 1  | 16 | 秋 |  |
|          | 02035017 | 金融工程学            | 否 | 否 | 2  | 32 | 秋 |  |
|          | 02035020 | 金融数学             | 否 | 否 | 2  | 32 | 秋 |  |
|          | 02035032 | 随机分析和连续时间金融学     | 否 | 否 | 2  | 32 | 秋 |  |
|          | 02035037 | 金融风险管理           | 否 | 否 | 2  | 32 | 春 |  |
|          | 02035057 | 数值分析             | 否 | 否 | 2  | 32 | 秋 |  |
|          | 02035058 | 信用风险管理           | 否 | 否 | 2  | 32 | 秋 |  |
|          | 02035060 | 中国资本市场微观结构       | 否 | 否 | 2  | 32 | 秋 |  |
|          | 02035063 | 信用衍生品与资产证券化专题    | 否 | 否 | 2  | 32 | 春 |  |
|          | 02037006 | 金融衍生工具           | 否 | 否 | 2  | 32 | 秋 |  |
|          | 02037008 | 金融统计与计量          | 否 | 否 | 2  | 32 | 秋 |  |
|          | 02037052 | SAS              | 否 | 否 | 2  | 32 | 秋 |  |
|          | 02037053 | 股票量化策略           | 否 | 否 | 2  | 32 | 春 |  |
|          | 02037056 | 趋势交易与短线战法        | 否 | 否 | 1  | 16 | 春 |  |
|          | 02037058 | 期权期货量化策略         | 否 | 否 | 1  | 16 | 春 |  |
|          | 02037059 | Python 在量化投资中的应用 | 否 | 否 | 2  | 32 | 秋 |  |
| 02105002 | 时间序列分析   | 否                | 否 | 2 | 32 | 秋  |   |  |

## 金融专业学位硕士课程设置计划（量化投资全日制）

学院：金融学院

适用年级：2017

学科专业名称：金融

学科专业代码：025100

| <b>方案总要求</b>       |                  | 总学分 不低于 28 学分   |               |      |    |    |      |     |  |
|--------------------|------------------|-----------------|---------------|------|----|----|------|-----|--|
| <b>公共课</b>         |                  | 5 学分            |               |      |    |    |      |     |  |
| <b>必修环节</b>        |                  | 2 学分            |               |      |    |    |      |     |  |
| <b>专业课</b>         |                  | 总学分 不低于 21 学分   |               |      |    |    |      |     |  |
| <b>专业基础课</b>       |                  | 计入总学分           |               |      |    |    |      |     |  |
| <b>计算机与数理方法模块</b>  |                  | 总学分 不低于 5 学分    |               |      |    |    |      |     |  |
| <b>量化产品与投资策略模块</b> |                  | 总学分 不低于 5 学分    |               |      |    |    |      |     |  |
| <b>跨专业课与公选课</b>    |                  | 计入总学分           |               |      |    |    |      |     |  |
| 课程类别               | 课程编码             | 课程名称            | 是否必修          | 是否学位 | 学分 | 学时 | 开课学期 | 备注  |  |
| 公共课                | 02167001         | 金融英语            | 是             | 是    | 3  | 48 | 秋    |     |  |
|                    | 13005006         | 中国特色社会主义理论与实践研究 | 是             | 是    | 2  | 32 | 秋    |     |  |
| 必修环节               | SJHJ7020         | 量化投资项目实习        | 是             | 否    | 2  |    |      |     |  |
| 专业课                | 专业基础课            | 02035012        | 投资组合管理        | 否    | 否  | 1  | 16   | 秋   |  |
|                    |                  | 02035060        | 中国资本市场微观结构    | 否    | 否  | 2  | 32   | 秋   |  |
|                    |                  | 02037002        | 财务报表分析        | 否    | 否  | 2  | 32   | 秋   |  |
|                    |                  | 02037005        | 投资学           | 否    | 否  | 2  | 32   | 秋   |  |
|                    |                  | 02037006        | 金融衍生工具        | 否    | 否  | 2  | 32   | 秋   |  |
|                    |                  | 02037008        | 金融统计与计量       | 否    | 否  | 2  | 32   | 秋   |  |
|                    | 计算机与数理方法模块       | 00105101        | 计量经济学         | 否    | 否  | 3  | 48   | 秋 春 |  |
|                    |                  | 02035020        | 金融数学          | 否    | 否  | 2  | 32   | 秋   |  |
|                    |                  | 02035032        | 随机分析和连续时间金融学  | 否    | 否  | 2  | 32   | 秋   |  |
|                    |                  | 02035057        | 数值分析          | 否    | 否  | 2  | 32   | 秋   |  |
|                    |                  | 02037052        | SAS           | 否    | 否  | 2  | 32   | 秋   |  |
|                    | 量化产品与投资策略模块      | 02105002        | 时间序列分析        | 否    | 否  | 2  | 32   | 秋   |  |
|                    |                  | 02035055        | 固定收益分析与量化策略   | 否    | 否  | 2  | 32   | 春   |  |
|                    |                  | 02035056        | 高频交易与对冲套利     | 否    | 否  | 2  | 32   | 春   |  |
|                    |                  | 02035058        | 信用风险管理        | 否    | 否  | 2  | 32   | 秋   |  |
|                    |                  | 02035063        | 信用衍生品与资产证券化专题 | 否    | 否  | 2  | 32   | 春   |  |
|                    |                  | 02037053        | 股票量化策略        | 否    | 否  | 2  | 32   | 春   |  |
|                    |                  | 02037056        | 趋势交易与短线战法     | 否    | 否  | 1  | 16   | 春   |  |
|                    |                  | 02037058        | 期权期货量化策略      | 否    | 否  | 1  | 16   | 春   |  |
| 02037059           | Python 在量化投资中的应用 | 否               | 否             | 2    | 32 | 秋  |      |     |  |