

## 金融学博士培养方案

### 一、培养目标

培养信念执着、品德优良、身心健康，具有扎实精深的专业知识和系统全面的经济学和管理学等学科的相关知识，能够运用先进的研究方法和手段独立进行金融学领域创新性研究，致力于高等院校、科研机构、政府部门从事金融领域的教学、科研或管理工作的高素质拔尖创新人才。

### 二、专业要求

1. 能够熟练地查找和阅读与本学科相关的中英文图书资料和学术刊物，能够把握金融学领域的历史发展和学术前沿，并能对现有相关理论进行批判性评价，创新性地设计研究方案。
2. 具有较强的写作能力，能够准确、充分地运用中英文资料撰写文献综述，并在本专业核心期刊上发表高水平学术论文。
3. 能够独立进行本专业研究课题的选题，承担并能独立完成省市或部委级科研项目。
4. 能够独立讲授本专业本科、硕士层次的基础课和选修课，并能获得较好的教学效果。
5. 能够使用英语直接参加国际学术交流活动，阐述自己的独立见解。

### 三、研究方向

1. 货币经济学
2. 金融经济学
3. 金融组织学
4. 金融工程学
5. 金融行为学
6. 金融科技

### 四、学习形式及学习年限

本专业的学习形式为全日制，基本学习年限为四年。在校休复学、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

本专业博士生最低学分要求为 21 学分，其中包括课程学分和必修环节学分。

1. 课程学分为 20 学分，其中，必修课 12 学分，选修课 8 学分（专业选修课不低于 4 学分）。博士生应在导师指导下制定个人培养计划、选择选修课。

跨学科背景的博士生根据自身学科基础知识掌握情况，可在导师指导下，补修 1 门或几门相应本专业硕士课程，建议补修课程为**微观经济学、宏观经济学、货币经济学、金融经济学和金融工程学**。

2. 必修环节学分为 1 学分。为加强学术规范与学术道德教育，所有研究生需修读《科研伦理与学术规范》课程，学生可选择秋或春季学期在线慕课开放期间进行自主学习、参加当学期线上考试。课程成绩由观看视频、平时作业、讨论和期末考试四部分构成，且视频学习累计时长达到课程视频总时长相应比例方可参加期末考试，成绩合格后获得相应学分。

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、其他环节要求

综合考核是博士生完成课程学习后，正式进入学位论文写作阶段前的一次中期考核，包括学业能力考核和科研能力考核两部分。学业能力考核要求提交一份以“三高课程”为基本内容和框架的书面学习报告，科研能力考核要求宣讲答辩一篇与博士学位论文选题相关的已发表的学术论文或未发表的工作论文。

博士生综合考核每年春、秋季各组织一次，具体时间由学院安排。博士生修满培养计划内规定的课程学分且成绩合格，方可参加综合考核。

## 七、毕业条件与学位授予

1. 本专业博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、环节成绩合格；
- (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. 博士生申请学位前的学术论文发表要求参见《对外经济贸易大学博士申请学位科研成果考核办法》、《金融学院博士申请学位科研成果考核办法》和《对外经济贸易大学博士研究生毕业与学位授予分离工作实施方案》。

4. 本专业授予经济学博士学位。

## 八、课程设置计划及专业阅读书目

## 金融学博士课程设置计划

学院：金融学院

适用年级：2020

学科专业名称：金融学

学科专业代码：020204

方案总要求		总学分 不低于 21 学分						
公共课		2 学分						
基础课		10 学分						
必修环节		1 学分						
专业课		总学分 不低于 4 学分						
跨专业课与公选课		计入总学分						
补硕士课		不计入总学分						
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	13006002	中国马克思主义与当代	是	是	2	32	秋	
基础课	00006001	博士公开课	是	是	1	16	秋	
	00026101	高级微观经济学	是	是	3	48	秋	
	00026103	高级宏观经济学	是	是	3	48	秋	
	00106101	高级计量经济学	是	是	3	48	春	
必修环节	BXHJ5011	科研伦理与学术规范	是	否	1			
专业课	02036011	货币经济专题	否	否	2	32	春	
	02036012	资本市场专题	否	否	2	32	春	
	02036013	国际金融专题	否	否	2	32	秋	
	02036014	公司金融专题	否	否	2	32	春	
	02036020	金融工程与风险管理专题	否	否	2	32	春	
	02036021	银行经济学专题	否	否	2	32	春	
	02036023	金融前沿理论及研究方法	否	否	2	32	秋	
	02036024	现代金融中介与金融合约专题	否	否	2	32	春	
补硕士课	00025101	微观经济学	否	否	3	48	秋 春	
	00025102	宏观经济学	否	否	3	48	秋 春	
	02025005	货币经济学	否	否	2	32	秋	
	02035005	金融经济学	否	否	2	32	秋	
	02035017	金融工程学	否	否	2	32	秋	
<b>专业阅读书目</b>								
<b>教材与专著：</b>								
1. 拉姆·拉玛纳山. 应用经济计量学. 机械工业出版社, 2003.								
2. 兹维·博迪, 罗伯特·默顿. 金融学. 中国人民大学出版社, 2010.								
3. 斯蒂芬·A·罗斯. 公司理财. 机械工业出版社, 2012.								
4. 兹维·博迪. 投资学精要. 中国人民大学出版社, 2010.								
5. Suresh. M. Sundaresan. 固定收入证券市场及其衍生产品. 北京大学出版社, 2003.								
6. 小詹姆斯·L·法雷尔. 投资组合管理: 理论及应用. 机械工业出版社, 2002.								
7. 唐·M·钱斯. 衍生金融工具与风险管理. 中信出版社, 2004.								
8. Ruey S. Tsay. Analysis of Financial Time Series(3rd edition). Wiley-Interscience, 2002.								

9. Joshua D. Angrist, Jörn-Steffen Pischke. Mostly Harmless Econometrics: An Empiricist's Companion. Princeton University Press, 2009.
10. Eckhard Platen, David Heath. A Benchmark Approach to Quantitative Finance. Springer, 2006.
11. J. S. Dagpunar. Simulation and Monte Carlo With Applications in Finance and MCMC. Wiley, 2007.
12. Paolo Brandimarte. Numerical Methods in Finance A MATLAB-Based Introduction. Wiley-Interscience, 2006.
13. Nicolas Privault. Notes on Stochastic Finance.
14. Paul Wilmott. Introduces Quantitative Finance. Wiley, 2010.
15. Shreve S. E. Stochastic Calculus for Finance I&II. Springer, 2004.
16. Sheldon Natenberg 编. 韩冰洁译. 期权波动率与定价. 机械工业出版社, 2014.
17. Victor Spearandeo 编. 丁圣元译. 专业投机原理. 机械工业出版社, 2010.

文献:

1. González-Urteaga, Ana and Gonzalo Rubio. The Cross-Sectional Variation of Volatility Risk Premia. Journal of Financial Economics 119, no. 2(2016): 353-370.
2. Carr, Peter and Liuren Wu. Analyzing Volatility Risk and Risk Premium in Option Contracts: A New Theory. Journal of Financial Economics 120, no. 1(2016): 1-20.
3. Ge Li, Tse-Chun Lin and Neil D. Pearson. Why Does the Option to Stock Volume Ratio Predict Stock Returns? Journal of Financial Economics 120, no. 3(2016): 601-622.
4. Filipovic, Damir, Elise Gourier and Loriano Mancini. Quadratic Variance Swap Models. Journal of Financial Economics 119, no. 1(2016): 44-68.
5. Qiu Jiaping and Fan Yu. Endogenous Liquidity in Credit Derivatives. Journal of Financial Economics 103, no. 3(2012): 611-631.
6. Cai Jie, Ralph A. Walkling and Ke Yang. The Price of Street Friends: Social Networks, Informed Trading, and Shareholder Costs. Journal of Financial and Quantitative Analysis, Forthcoming, 2014.
7. Rytchkov, Oleg. Asset Pricing With Dynamic Margin Constraints. Journal of Finance 69, no. 1(2014): 405-452.
8. Engle, Robert F. Autoregressive Conditional Heteroscedasticity with Estimates of the Variance of United Kingdom Inflation. Econometrica: Journal of the Econometric Society(1982): 987-1007.
9. Engle, Robert F. and Clive WJ Granger. Co-integration and Error Correction: Representation, Estimation, and Testing. Econometrica: Journal of the Econometric Society(1987): 251-276.
10. Merton, Robert C. On the Pricing of Corporate Debt: The Risk Structure of Interest Rates. Journal of Finance 29, no. 2(1974): 449-470.
11. Merton, Robert C. Theory of Rational Option Pricing. The Bell Journal of Economics and Management Science(1973): 141-183.
12. Markowitz. Portfolio Selection. JF, 1952. (均值-方差模型)
13. Arrow, Debreu. Existence of an Equilibrium for a Competitive Economy. Econometrica, 1954. (Arrow-Debreu 均衡)
14. Modigliani, Miller. The Cost of Capital, Corporation Finance and the Theory of Investment. AER, 1958. (MM 定理)
15. Sharpe. Capital Asset Prices-A Theory of Market Equilibrium under Conditions of Risk. JF, 1964. (CAPM)
16. Lintner. Security Prices, Risk, and Maximal Gains From Diversification. JF, 1965.(CAPM)
17. Mossin. Equilibrium in a Capital Asset Market. Econometrica, 1966. (CAPM)
18. Ross. The Arbitrage Theory of Capital Asset Pricing. JET, 1976. (APT)

19. Black, Scholes. The Pricing of Options and Corporate Liabilities. JPE, 1973. (B-S)
20. Merton, Bell. Theory of Rational Option Pricing. JEMS, 1973. (B-S)
21. Samuelson. Proof that Properly Anticipated prices Fluctuate Randomly. Industrial Management Review, 1965. (EMH)
22. Fama. Efficient Capital Markets-A Review of Theory and Empirical Work. JF, 1970. (EMH)
23. Fama. Market Efficiency, Long-term returns and Behavioral Finance. JFE, 1998. (EMH)
24. Fama, French. Common Risk Factors in The returns on Stocks and Bonds. JFE, 1993. (三因子模型)
25. Fama, French. Multifactor Explanations of Asset Pricing Anomalies. JF, 1996. (三因子模型)
26. Siegel, Thaler. Anomalies-The Equity Premium Puzzle. JEP, 1997. (股权溢价之谜)

**期刊:**

1. American Economic Review
2. Econometrica
3. Journal of Financial and Quantitative Analysis
4. Journal of Financial Economics
5. Journal of Finance
6. Journal of Trading
7. Journal of Political Economy
8. Journal of Econometrics
9. Mathematical Finance
10. Management Science
11. Operations Research
12. Quarterly Journal of Economics
13. Review of Financial Studies
14. 经济研究
15. 管理世界
16. 金融研究

**网站:**

1. SSRN
2. NBER

## 金融学学术型硕士培养方案

### 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与实务、能够把握国家经济金融政策、精通和掌握金融某一专业领域的知识和技能、具有国际视野和国际交流能力的应用型高级金融技术和管理人才。

### 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. 具有扎实的经济学理论和金融学理论基础，系统掌握现代金融学原理和金融专业知识。
3. 较为熟练地掌握英语，能阅读本专业的英文资料，并能综合运用。
4. 具有较强阅读文献的能力和科学研究能力；初步具备独立承担与专业研究相关工作的能力和创新能力；具备继续深造或者从事金融研究的知识水平和学术潜质。
5. 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

1. 货币理论与政策
2. 国际金融理论与政策
3. 银行管理
4. 资本市场
5. 公司金融
6. 金融风险管理
7. 金融工程
8. 投资理论与实务

### 四、学习形式及学习年限

本专业的学习形式为全日制，基本学习年限为二年。在校休复学、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

本专业硕士生最低学分要求为 27 学分，其中包括课程学分和必修环节学分。

1. 课程学分为 26 学分，其中，必修课 16 学分，选修课 10 学分（专业选修课不低于 4 学分）。研究生应在导师指导下制定个人培养计划、选择选修课。

2. 必修环节学分为 1 学分。为加强学术规范与学术道德教育，所有研究生需修读《科研伦理与学术规范》课程，学生可选择秋或春季学期在线慕课开放期间进行自主学习、参加当学期线上考试。课程成绩由观看视频、平时作业、讨论和期末考试四部分构成，且视频学习累计时长达到课程视频总时长相应比例方可参加期末考试，成绩合格后获得相应学分。

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. 本专业授予经济学硕士学位。

## 七、课程设置计划及专业阅读书目

## 金融学学术型硕士课程设置计划

学院：金融学院

适用年级：2020

学科专业名称：金融学

学科专业代码：020204

方案总要求		总学分 不低于 27 学分						
公共课		7 学分						
基础课		9 学分						
必修环节		1 学分						
专业课		总学分 不低于 4 学分						
跨专业课与公选课		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	00165001	高级英语 ( I )	是	是	2	32	秋	
	00165002	高级英语 ( II )	是	是	2	32	春	
	13005006	中国特色社会主义理论与实践研究	是	是	2	32	秋	
	13005007	马克思主义与社会科学方法论	是	是	1	16	春	
基础课	00025101	微观经济学	是	是	3	48	秋 春	
	00025102	宏观经济学	是	是	3	48	秋 春	
	00105101	计量经济学	是	是	3	48	秋 春	
必修环节	BXHJ5011	科研伦理与学术规范	是	否	1			
专业课	02025005	货币经济学	否	否	2	32	秋	
	02025009	计量经济软件及应用	否	否	1	16	秋	
	02025010	转型时期的中国宏观经济政策	否	否	1	16	春	
	02035005	金融经济学	否	否	2	32	秋	
	02035009	行为金融学	否	否	2	32	春	
	02035017	金融工程学	否	否	2	32	秋	
	02035019	金融工程案例研究	否	否	2	32	春	
	02035020	金融数学	否	否	2	32	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	
	02035032	随机分析和连续时间金融学	否	否	2	32	春	
	02035036	投资分析与交易技术	否	否	2	32	秋	
	02035037	金融风险管理	否	否	2	32	春	
	02035045	公司金融	否	否	2	32	秋	
	02035046	投资组合管理	否	否	2	32	秋	
	02035050	货币理论与货币政策分析	否	否	1	16	秋	
	02035051	财务报表分析	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	
02035057	数值分析	否	否	2	32	秋		
02035060	中国资本市场微观结构	否	否	2	32	秋		



02035061	宏观金融规划与政策	否	否	2	32	春	
02035062	投资银行专题	否	否	2	32	秋	
02035063	信用衍生品与资产证券化专题	否	否	2	32	春	
02035064	互联网金融与金融科技	否	否	1	16	春	
02035068	兼并与收购专题	否	否	1	16	春	
02035069	私人财富管理案例	否	否	2	32	秋	
02035070	固定收益证券专题	否	否	2	32	秋	
02035071	公司金融前沿专题与论文写作	否	否	2	32	秋	
02035072	实证公司金融	否	否	2	32	春	
02035073	金融社会学	否	否	2	32	春	
02035074	R 语言经济数据分析	否	否	2	32	春	
02035075	商品期货与期权市场实务	否	否	2	32	秋	
02035076	公司金融实证方法	否	否	2	32	春	
02035077	估值与投资	否	否	2	32	春	
02036011	货币经济专题	否	否	2	32	春	
02036012	资本市场专题	否	否	2	32	春	
02036013	国际金融专题	否	否	2	32	秋	
02036014	公司金融专题	否	否	2	32	春	
02036020	金融工程与风险管理专题	否	否	2	32	春	
02036021	银行经济学专题	否	否	2	32	春	
02036023	金融前沿理论及研究方法	否	否	2	32	秋	
02036024	现代金融中介与金融合约专题	否	否	2	32	春	
02105002	时间序列分析	否	否	2	32	秋	

## 专业阅读书目

## 教材与专著:

1. 拉姆·拉玛纳山. 应用经济计量学. 机械工业出版社, 2003.
2. 兹维·博迪, 罗伯特·默顿. 金融学. 中国人民大学出版社, 2010.
3. 斯蒂芬·A·罗斯. 公司理财. 机械工业出版社, 2012.
4. 兹维·博迪. 投资学精要. 中国人民大学出版社, 2010.
5. Suresh. M. Sundaresan. 固定收入证券市场及其衍生产品. 北京大学出版社, 2003.
6. 小詹姆斯·L·法雷尔. 投资组合管理: 理论及应用. 机械工业出版社, 2002.
7. 唐·M·钱斯. 衍生金融工具与风险管理. 中信出版社, 2004.
8. Ruey S. Tsay. Analysis of Financial Time Series(3rd edition). Wiley-Interscience, 2002.
9. Joshua D. Angrist, Jörn-Steffen Pischke. Mostly Harmless Econometrics: An Empiricist's Companion. Princeton University Press, 2009.
10. Eckhard Platen, David Heath. A Benchmark Approach to Quantitative Finance. Springer, 2006.
11. J. S. Dagpunar. Simulation and Monte Carlo With Applications in Finance and MCMC. Wiley, 2007.
12. Paolo Brandimarte. Numerical Methods in Finance A MATLAB-Based Introduction. Wiley-Interscience, 2006.
13. Nicolas Privault. Notes on Stochastic Finance.
14. Paul Wilmott. Introduces Quantitative Finance. Wiley, 2010.
15. Shreve S. E. Stochastic Calculus for Finance I&II. Springer, 2004.
16. Sheldon Natenberg 编. 韩冰洁译. 期权波动率与定价. 机械工业出版社, 2014.

17. Victor Spearandeo 编. 丁圣元译. 专业投机原理. 机械工业出版社, 2010.

**文献:**

1. González-Urteaga, Ana and Gonzalo Rubio. The Cross-Sectional Variation of Volatility Risk Premia. *Journal of Financial Economics* 119, no. 2(2016): 353-370.
2. Carr, Peter and Liuren Wu. Analyzing Volatility Risk and Risk Premium in Option Contracts: A New Theory. *Journal of Financial Economics* 120, no. 1(2016): 1-20.
3. Ge Li, Tse-Chun Lin and Neil D. Pearson. Why Does the Option to Stock Volume Ratio Predict Stock Returns? *Journal of Financial Economics* 120, no. 3(2016): 601-622.
4. Filipovic, Damir, Elise Gourier and Loriano Mancini. Quadratic Variance Swap Models. *Journal of Financial Economics* 119, no. 1(2016): 44-68.
5. Qiu Jiaping and Fan Yu. Endogenous Liquidity in Credit Derivatives. *Journal of Financial Economics* 103, no. 3(2012): 611-631.
6. Cai Jie, Ralph A. Walkling and Ke Yang. The Price of Street Friends: Social Networks, Informed Trading, and Shareholder Costs. *Journal of Financial and Quantitative Analysis*, Forthcoming, 2014.
7. Rytchkov, Oleg. Asset Pricing With Dynamic Margin Constraints. *Journal of Finance* 69, no. 1(2014): 405-452.
8. Engle, Robert F. Autoregressive Conditional Heteroscedasticity with Estimates of the Variance of United Kingdom Inflation. *Econometrica: Journal of the Econometric Society*(1982): 987-1007.
9. Engle, Robert F. and Clive WJ Granger. Co-integration and Error Correction: Representation, Estimation, and Testing. *Econometrica: Journal of the Econometric Society*(1987): 251-276.
10. Merton, Robert C. On the Pricing of Corporate Debt: The Risk Structure of Interest Rates. *Journal of Finance* 29, no. 2(1974): 449-470.
11. Merton, Robert C. Theory of Rational Option Pricing. *The Bell Journal of Economics and Management Science*(1973): 141-183.
12. Markowitz. Portfolio Selection. *JF*, 1952. (均值-方差模型)
13. Arrow, Debreu. Existence of an Equilibrium for a Competitive Economy. *Econometrica*, 1954. (Arrow-Debreu 均衡)
14. Modigliani, Miller. The Cost of Capital, Corporation Finance and the Theory of Investment. *AER*, 1958. (MM 定理)
15. Sharpe. Capital Asset Prices-A Theory of Market Equilibrium under Conditions of Risk. *JF*, 1964. (CAPM)
16. Lintner. Security Prices, Risk, and Maximal Gains From Diversification. *JF*, 1965.(CAPM)
17. Mossin. Equilibrium in a Capital Asset Market. *Econometrica*, 1966. (CAPM)
18. Ross. The Arbitrage Theory of Capital Asset Pricing. *JET*, 1976. (APT)
19. Black, Scholes. The Pricing of Options and Corporate Liabilities. *JPE*, 1973. (B-S)
20. Merton, Bell. Theory of Rational Option Pricing. *JEMS*, 1973. (B-S)
21. Samuelson. Proof that Properly Anticipated prices Fluctuate Randomly. *Industrial Management Review*, 1965. (EMH)
22. Fama. Efficient Capital Markets-A Review of Theory and Empirical Work. *JF*, 1970. (EMH)
23. Fama. Market Efficiency, Long-term returns and Behavioral Finance. *JFE*, 1998. (EMH)
24. Fama, French. Common Risk Factors in The returns on Stocks and Bonds. *JFE*, 1993. (三因子模型)
25. Fama, French. Multifactor Explanations of Asset Pricing Anomalies. *JF*, 1996. (三因子模型)
26. Siegel, Thaler. Anomalies-The Equity Premium Puzzle. *JEP*, 1997. (股权溢价之谜)

**期刊:**

1. American Economic Review
2. Econometrica
3. Journal of Financial and Quantitative Analysis
4. Journal of Financial Economics
5. Journal of Finance
6. Journal of Trading
7. Journal of Political Economy
8. Journal of Econometrics
9. Mathematical Finance
10. Management Science
11. Operations Research
12. Quarterly Journal of Economics
13. Review of Financial Studies
14. 经济研究
15. 管理世界
16. 金融研究

**网站:**

1. SSRN
2. NBER

## 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

1. 银行管理
2. 资本市场
3. 金融工程
4. 量化投资

### 四、学习形式及学习年限

本专业的学习形式为全日制，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

本专业硕士生最低学分要求为 29 学分，其中包括课程学分和必修环节学分。

1. 普通全日制（含银行管理、资本市场、金融工程方向）课程学分为 24 学分，其中，必修课 12 学分，选修课 12 学分（专业选修课不低于 6 学分）；量化投资方向课程学分为 26 学分，其中，必修课 5 学分，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）。研究生应在导师指导下制定个人培养计划、选择选修课。

2. 普通全日制（含银行管理、资本市场、金融工程方向）必修环节学分为 5 学分，其中，科研伦理与学术规范 1 学分，鸿儒金融实务系列讲座 1 学分，专业实习 3 学分；量化投资方向必修环节学分为 3 学分，其中，科研伦理与学术规范 1 学分，量化投资项目实习 2 学分。

为加强学术规范与学术道德教育，所有研究生需修读《科研伦理与学术规范》课程，学生可选择秋或春季学期在线慕课开放期间进行自主学习、参加当学期线上考试。课程成绩由观看视频、平时作业、讨论和期末考试四部分构成，且视频学习累计时长达到课程视频总时长相应比例方可参加期末考试，成绩合格后获得相应学分。

要求普通全日制学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 4 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；第一学年至少应参加鸿儒金融实务系列讲座 6 次，且完成与讲座相关的 2000 字心得体会。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。

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、环节成绩合格；
- (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: 2020

学科专业名称: 金融

学科专业代码: 025100

方案总要求		总学分 不低于 29 学分							
公共课		5 学分							
基础课		7 学分							
必修环节		5 学分							
专业课		总学分 不低于 6 学分							
银行管理模块		计入总学分							
资本市场模块		计入总学分							
金融工程模块		计入总学分							
实证方法模块		计入总学分							
跨专业课与公选课		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	BXHJ5011	科研伦理与学术规范	是	否	1				
	BXHJ7007	鸿儒金融实务系列讲座	是	否	1				
	SJHJ7022	专业实习	是	否	3				
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	
		02035061	宏观金融规划与政策	否	否	2	32	春	
		02035073	金融社会学	否	否	2	32	春	
		02037030	银行营销	否	否	1	16	春	
		02037033	小企业金融实务	否	否	2	32	春	
	资本市场模块	02035005	金融经济学	否	否	2	32	秋	
		02035009	行为金融学	否	否	2	32	春	
		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	
		02035036	投资分析与交易技术	否	否	2	32	秋	
		02035046	投资组合管理	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	
		02035062	投资银行专题	否	否	2	32	秋	
02035064	互联网金融与金融科技	否	否	1	16	春			
02035068	兼并与收购专题	否	否	1	16	春			

金融学院研究生培养方案

	02035069	私人财富管理案例	否	否	2	32	秋	
	02035070	固定收益证券专题	否	否	2	32	秋	
	02035071	公司金融前沿专题与论文写作	否	否	2	32	秋	
	02035072	实证公司金融	否	否	2	32	春	
	02035077	估值与投资	否	否	2	32	春	
	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	
	02037057	金融市场与机构	否	否	2	32	秋	
金融工程模块	02035017	金融工程学	否	否	2	32	秋	
	02035019	金融工程案例研究	否	否	2	32	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	春	
	02035037	金融风险管理	否	否	2	32	春	
	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	
	02035075	商品期货与期权市场实务	否	否	2	32	秋	
	02037006	金融衍生工具	否	否	2	32	秋	
	02037053	股票量化策略	否	否	2	32	秋	
	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	
实证方法模块	02025009	计量经济软件及应用	否	否	1	16	秋	
	02035057	数值分析	否	否	2	32	秋	
	02035074	R语言经济数据分析	否	否	2	32	春	
	02035076	公司金融实证方法	否	否	2	32	春	
	02037008	金融统计与计量	否	否	2	32	秋	
	02037052	SAS	否	否	2	32	秋	
	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)

学院：金融学院

适用年级：2020

学科专业名称：金融

学科专业代码：025100

方案总要求		总学分 不低于 29 学分							
公共课		5 学分							
必修环节		3 学分							
专业课		总学分 不低于 15 学分							
专业基础课		计入总学分							
计算机与数理方法模块		总学分 不低于 5 学分							
量化产品与投资策略模块		总学分 不低于 5 学分							
跨专业课与公选课		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	BXHJ5011	科研伦理与学术规范	是	否	1				
	SJHJ7020	量化投资项目实习	是	否	2				
专业课	专业基础课	02035009	行为金融学	否	否	2	32	春	
		02035046	投资组合管理	否	否	2	32	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	春	
		02035057	数值分析	否	否	2	32	秋	
		02035074	R 语言经济数据分析	否	否	2	32	春	
		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	
		02035063	信用衍生品与资产证券化专题	否	否	2	32	春	
		02035075	商品期货与期权市场实务	否	否	2	32	秋	
		02035077	估值与投资	否	否	2	32	春	
		02037053	股票量化策略	否	否	2	32	秋	
		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			



## 专业阅读书目

## 教材与专著:

1. 拉姆·拉玛纳山. 应用经济计量学. 机械工业出版社, 2003.
2. 兹维·博迪, 罗伯特·默顿. 金融学. 中国人民大学出版社, 2010.
3. 斯蒂芬·A·罗斯. 公司理财. 机械工业出版社, 2012.
4. 兹维·博迪. 投资学精要. 中国人民大学出版社, 2010.
5. Suresh. M. Sundaresan. 固定收入证券市场及其衍生产品. 北京大学出版社, 2003.
6. 小詹姆斯·L·法雷尔. 投资组合管理: 理论及应用. 机械工业出版社, 2002.
7. 唐·M·钱斯. 衍生金融工具与风险管理. 中信出版社, 2004.
8. Ruey S. Tsay. Analysis of Financial Time Series(3rd edition). Wiley-Interscience, 2002.
9. Joshua D. Angrist, Jörn-Steffen Pischke. Mostly Harmless Econometrics: An Empiricist's Companion. Princeton University Press, 2009.
10. Eckhard Platen, David Heath. A Benchmark Approach to Quantitative Finance. Springer, 2006.
11. J. S. Dagpunar. Simulation and Monte Carlo With Applications in Finance and MCMC. Wiley, 2007.
12. Paolo Brandimarte. Numerical Methods in Finance A MATLAB-Based Introduction. Wiley-Interscience, 2006.
13. Nicolas Privault. Notes on Stochastic Finance.
14. Paul Wilmott. Introduces Quantitative Finance. Wiley, 2010.
15. Shreve S. E. Stochastic Calculus for Finance I&II. Springer, 2004.
16. Sheldon Natenberg 编. 韩冰洁译. 期权波动率与定价. 机械工业出版社, 2014.
17. Victor Spearandeo 编. 丁圣元译. 专业投机原理. 机械工业出版社, 2010.

## 文献:

1. González-Urteaga, Ana and Gonzalo Rubio. The Cross-Sectional Variation of Volatility Risk Premia. Journal of Financial Economics 119, no. 2(2016): 353-370.
2. Carr, Peter and Liuren Wu. Analyzing Volatility Risk and Risk Premium in Option Contracts: A New Theory. Journal of Financial Economics 120, no. 1(2016): 1-20.
3. Ge Li, Tse-Chun Lin and Neil D. Pearson. Why Does the Option to Stock Volume Ratio Predict Stock Returns? Journal of Financial Economics 120, no. 3(2016): 601-622.
4. Filipovic, Damir, Elise Gourier and Lorian Mancini. Quadratic Variance Swap Models. Journal of Financial Economics 119, no. 1(2016): 44-68.
5. Qiu Jiaping and Fan Yu. Endogenous Liquidity in Credit Derivatives. Journal of Financial Economics 103, no. 3(2012): 611-631.
6. Cai Jie, Ralph A. Walkling and Ke Yang. The Price of Street Friends: Social Networks, Informed Trading, and Shareholder Costs. Journal of Financial and Quantitative Analysis, Forthcoming, 2014.
7. Rytchkov, Oleg. Asset Pricing With Dynamic Margin Constraints. Journal of Finance 69, no. 1(2014): 405-452.
8. Engle, Robert F. Autoregressive Conditional Heteroscedasticity with Estimates of the Variance of United Kingdom Inflation. Econometrica: Journal of the Econometric Society(1982): 987-1007.
9. Engle, Robert F. and Clive WJ Granger. Co-integration and Error Correction: Representation, Estimation, and Testing. Econometrica: Journal of the Econometric Society(1987): 251-276.
10. Merton, Robert C. On the Pricing of Corporate Debt: The Risk Structure of Interest Rates. Journal of Finance 29, no. 2(1974): 449-470.

11. Merton, Robert C. Theory of Rational Option Pricing. The Bell Journal of Economics and Management Science(1973): 141-183.
12. Markowitz. Portfolio Selection. JF, 1952. (均值-方差模型)
13. Arrow, Debreu. Existence of an Equilibrium for a Competitive Economy. Econometrica, 1954. (Arrow-Debreu 均衡)
14. Modigliani, Miller. The Cost of Capital, Corporation Finance and the Theory of Investment. AER, 1958. (MM 定理)
15. Sharpe. Capital Asset Prices-A Theory of Market Equilibrium under Conditions of Risk. JF, 1964. (CAPM)
16. Lintner. Security Prices, Risk, and Maximal Gains From Diversification. JF, 1965.(CAPM)
17. Mossin. Equilibrium in a Capital Asset Market. Econometrica, 1966. (CAPM)
18. Ross. The Arbitrage Theory of Capital Asset Pricing. JET, 1976. (APT)
19. Black, Scholes. The Pricing of Options and Corporate Liabilities. JPE, 1973. (B-S)
20. Merton, Bell. Theory of Rational Option Pricing. JEMS, 1973. (B-S)
21. Samuelson. Proof that Properly Anticipated prices Fluctuate Randomly. Industrial Management Review, 1965. (EMH)
22. Fama. Efficient Capital Markets-A Review of Theory and Empirical Work. JF, 1970. (EMH)
23. Fama. Market Efficiency, Long-term returns and Behavioral Finance. JFE, 1998. (EMH)
24. Fama, French. Common Risk Factors in The returns on Stocks and Bonds. JFE, 1993. (三因子模型)
25. Fama, French. Multifactor Explanations of Asset Pricing Anomalies. JF, 1996. (三因子模型)
26. Siegel, Thaler. Anomalies-The Equity Premium Puzzle. JEP, 1997. (股权溢价之谜)

**期刊:**

1. American Economic Review
2. Econometrica
3. Journal of Financial and Quantitative Analysis
4. Journal of Financial Economics
5. Journal of Finance
6. Journal of Trading
7. Journal of Political Economy
8. Journal of Econometrics
9. Mathematical Finance
10. Management Science
11. Operations Research
12. Quarterly Journal of Economics
13. Review of Financial Studies
14. 经济研究
15. 管理世界
16. 金融研究

**网站:**

1. SSRN
2. NBER