

广东外语外贸大学硕士研究生培养方案

专业名称：金融工程（2019 级）

专业代码：0202Z1

一、培养目标

培养具有实际开发能力的高级金融工程人才，通过系统的理论学习和实践锻炼，要求有较扎实和全面的现代金融理论知识，熟练掌握和灵活运用金融工程技术、方法、工具，创造性地解决金融实际问题。能够从事资产定价、风险控制、产品设计与创新等工作。

二、研究方向

1. 风险管理与保险精算
2. 数理金融与资产组合

三、学习年限

学习年限一般为 3 年，学习年限最长不超过 5 年（含休学）。

四、必读文献

（一）基础经典著作

1. 《资本论》，卡尔·马克思(Marx K.)著，何小禾译，重庆出版社，2014 年 10 月；
2. 《国富论》，亚当·斯密（Adam Smith）著，胡长明译，重庆出版社，2015 年 8 月；
3. 《就业、利息和货币通论》（重译本），凯恩斯 出版社:商务印书馆 出版，2014 年 11 月；
4. 《经济分析史》（三卷），约瑟夫·熊彼特著，商务印书馆，2015 年 4 月；
5. 《经济学原理》，曼昆著，梁小民、梁砾译，北京大学出版社，2015 年 5 月；
6. 《微观经济学》，平狄克，鲁宾费尔德著，李彬译，中国人民大学出版社，2013 年 6 月；

7. 《宏观经济学》，多恩布什、费希尔著，王志伟译，中国人民大学出版社，2017年2月；
8. 《微观经济学：现代观点》，范里安著，费方域译，格致出版社，2015年1月；
9. 《计量经济学导论》，伍德里奇著，张成思、李红、张步昊译，中国人民大学出版社，2015年5月；
10. 《国际经济学：理论与政策》，保罗·R·克鲁格曼 茅瑞斯·奥伯斯法尔德著，黄卫平译，中国人民大学出版社，2016年5月；
11. 《现代宏观经济学:起源、发展和现状》，斯诺登著，余江涛译，江苏人民出版社，2019年3月；
12. 《20世纪西方经济学的发展》，高鸿业，刘凤良著，商务印书馆，2004年4月；
13. 《经济思想的成长》，亨利·威廉·斯皮格尔著，晏智杰，刘宇飞，王长青，蒋怀栋译，中国社会科学出版社，1999年10月；
14. 《世界经济简史——从旧石器时代到20世纪末（第四版）》，龙多·卡梅伦(Rondo Cameron)、拉里·尼尔(Larry Neal)著，潘宁等译，上海译文出版社，2012年8月；
15. 《中国经济史》，钱穆讲述，叶龙记录整理，北京联合出版公司，2014年1月；
16. 《中国经济指南》，邹至庄、吴敬琏、林毅夫、李稻葵、余永定、林满红、里查德·弗里曼、黄季琨、易纲、郭凯、德怀特·H. 柏金斯等国内外的经济学家联合编写，清华大学出版社，2016年1月；
17. 《伟大的中国经济转型》，劳伦·勃兰特、托马斯·罗斯基著，方颖、赵扬译，格致出版社，2016年1月；
18. 《魔鬼经济学系列》，史蒂芬·列维特、史蒂芬·都伯纳著，王晓鹏、汤珑、曾贤明译，中信出版集团，2016年9月；
19. 《一转念：用经济学思考》，兰小欢著，上海三联书店，2011年5月；
20. 《21世纪资本论》，托马斯·皮凯蒂著，巴曙松译，中信出版社，2014年9月；
21. 《国家为什么会失败》，德隆·阿西莫格鲁，詹姆斯·A. 罗宾逊著，李增刚译，湖南科学技术出版社，2015年6月；
22. 《斯坦福极简经济学：如何果断地权衡利益得失》，蒂莫西·泰勒(Timothy Taylor)著，林隆全译，湖南人民出版社，2015年2月；
23. 《增长为什么重要：来自当代印度的发展经验》，贾格迪什·巴格瓦蒂，

阿尔温德.帕纳格里亚著，王志毅译，浙江大学出版社，2015 年 8 月；

24. 《全球大趋势》，约瑟夫·E. 施蒂格利茨、阿伦·S.埃德林、J.布拉德福德·德朗著，徐浩译，南海出版社，2011 年 5 月；

25. 《国家竞争优势》，迈克尔·波特(Michael E. Porter)著，李明轩、邱如美译，中信出版社，2012 年 8 月；

26. 《宏观经济学二十五讲》，徐高著，中国人民大学出版社，2019 年 2 月。

（二）金融学专业著作

1. 《货币金融学》，弗雷德里克·S·米什金(Frederic S. Mishkin)著，郑艳文、荆国勇译，中国人民大学出版社，2016 年 9 月；

2. 《金融经济学》，弗兰克·J·法博齐 (Frank J. Fabozzi)，埃德温·H·尼夫 (Edwin H. Neave)，周国富著，孔爱国、张轶凡、冯旭、孙汉文译，机械工业出版社，2015 年 8 月；

3. 《资本市场：机构与工具》(第四版)，弗兰克·J·法博齐，弗朗哥·莫迪利亚尼著，汪涛、郭宁译，中国人民大学出版社，2015 年 6 月；

4. 《私人财富管理（实践篇）》，斯蒂芬·M.霍兰 (Stephen M. Horan) 著，翟立宏、蔡栋梁、盛方富译，机械工业出版社，2015 年 11 月；

5. 《国际金融（第十版）》，保罗·R·克鲁格曼，茅瑞斯·奥伯斯法尔德，马克·J·梅里兹 (Marc J.Melitz)著，丁凯、陈能军、陈桂军译，中国人民大学出版社，2016 年 3 月；

6. 《公司理财(原书第 11 版)》，斯蒂芬 A. 罗斯 (Stephen A. Ross)，伦道夫·W. 威斯特菲尔德 (Randolph W. Westerfield)，杰弗利·F.杰富 (Jeffrey F. Jaffe)，布拉德福德·D.乔丹 (Bradford D.Jordan) 著，吴世农、沈艺峰、王志强译，机械工业出版社 2017 年 7 月；

7. 《投资学(原书第 10 版)》，滋维·博迪 (Zvi Bodie)，亚历克斯·凯恩 (Alex Kane)，艾伦·J.马库斯 (Alan J. Marcus)著，汪昌云，张永骥译，机械工业出版社，2017 年 7 月；

8. 《期权、期货及其他衍生产品(原书第 10 版)》，约翰·赫尔 (John C. Hull)，王勇、索吾林译，机械工业出版社，2018 年 7 月；

9. 《中国式财富管理：不可不知的未来财富管理知识》，金李，袁慰著，中信出版社，2017 年 11 月；

10. 《金融经济学二十五讲》，徐高著，中国人民大学出版社，2018 年 7 月；

11. 《商业银行管理(原书第 9 版 中国版)》，彼得 S.罗斯，西尔维娅·C.赫金斯 (Sylvia C. Hudgins)，戴国强著，机械工业出版社，2016 年 7 月；

12. 《投资银行、对冲基金和私募股权投资》，戴维·斯托厄尔 (David P. Stowell) 著，黄嵩、赵鹏等译，机械工业出版社，2013 年 4 月；
13. 《世界是部金融史》，陈雨露，杨栋著，江西教育出版社，2016 年 4 月；
14. 《金融学文献通论：宏观金融卷》，陈雨露，汪昌云著，中国人民大学出版社，2006 年 11 月；
15. 《金融学文献通论 微观金融卷》，陈雨露，汪昌云著，中国人民大学出版社，2006 年 11 月；
16. 《系统性风险、危机与宏观审慎监管》，泽维尔·弗雷克萨萨斯著，中国金融出版社，2017 年 1 月；
17. 《金融炼金术的终结》，默文·金 (Mervyn King) 出版社:中信出版社，2016 年 9 月；
18. 《巴菲特传：一个美国资本家的成长》，罗杰·洛温斯坦 (Roger Lowenstein) 著，蒋旭峰、王丽萍译，中信出版社，2008 年 9 月；
19. 《摩根财团：美国一代银行王朝和现代金融业的崛起 (1838~1990)》，罗恩·彻诺 (R. Chernow) 著，金立群译，上海文汇出版社，2017 年 8 月；
20. 《繁荣的真谛》，路易吉·津加莱斯 (Luigi Zingales) 著，余江译，中信出版社，2015 年 7 月；
21. 《压力测试：对金融危机的反思》，蒂莫西·盖特纳 (Timothy Geithne) 著，益智译，中信出版社，2015 年 3 月；
22. 《这次不一样：八百年金融危机史(珍藏版)》，莱因哈特，罗格夫著，綦相、刘晓峰、刘丽娜译，机械工业出版社，2012 年 9 月；
23. 《金融计量：金融市场统计分析 (原书第 4 版)》，于尔根·弗兰克 (Jürgen Franke) 著，机械工业出版社，2016 年 10 月；
24. 《保险经济学前沿问题研究》，迪翁主编，朱铭来等译校，中国金融出版社，2007 年 11 月；
25. 《非理性繁荣(第三版)(修订版) 精装》，罗伯特·J·希勒 (Robert J. Shiller) 著，李心丹等译，中国人民大学出版社，2016 年 5 月 1 日；
26. 《行为金融学新进展 (II) (2017 年诺贝尔经济学奖获奖作品)》，理查德·H·泰勒主编，贺京同等译，中国人民大学出版社，2014 年 10 月；
27. 《系统性风险、危机与宏观审慎监管》，泽维尔·弗雷克萨萨斯著，中国金融出版社，2017 年 1 月；
28. 《百年中国金融思想学说史》，曾康霖、刘锡良、缪明杨著，中国金融出版社，2018 年 3 月。

（三）专业学术期刊

1. American Economic Review
2. Econometrica
3. Journal of Political Economy
4. Quarterly Journal of Economics
5. Journal of Finance
6. Review of Economic Studies
7. Journal of International Economics
8. Journal of Public Economics
9. Journal of Econometrics
10. Journal of Monetary Economics
11. Journal of Labor Economics
12. Review of Economics and Statistics
13. Journal of Financial Economics
14. Review of Financial Studies
15. Journal of Quantitative and Financial Analysis
16. Review of Finance
17. Financial Management
18. Journal of Banking and Finance
19. Journal of Corporate Finance
20. Journal of Financial Intermediation
21. Journal of International Money and Finance
22. Journal of Risk and Insurance
23. Mathematical Finance
24. 中国社会科学
25. 经济研究
26. 管理世界
27. 金融研究
28. 经济学（季刊）
29. 世界经济
30. 中国工业经济
31. 财贸经济
32. 国际金融研究
33. 保险研究

五、课程设置和学分要求

硕士研究生实行学分制，其中课程学习时间为两年以上，其间必需修满 36 个学分，撰写学位论文的时间为一年至一年半。

课程分为学位公共课、学位专业课和公共选修课。学位公共课是指根据教育部要求硕士研究生必修的政治理论课和外国语（针对外语专业指第二外国语）。其中，政治课 3 学分，外国语 4 学分，共 7 学分。学位专业课分专业必修课和专业选修课。专业必修课 14 学分，专业选修课 13 学分（必选课 5 学分）。教学实践与科学训练 1 学分，前沿讲座 2 学分。

跨专业入学和以同等学力入学的硕士研究生必须补修两门与本专业相关的大学本科课程，所修学分不计入上述学分。

跨专业入学和以同等学力入学的硕士研究生补修本科课程（任选两门）：

1. 货币银行学
2. 国际金融学
3. 投资学

类别	课程编号	课程名称	学分	总学时	开课学期				考核方式	必修或选修	适应方向
					1	2	3	4			
学位公共课程 7 学分	00002101	中国特色社会主义理论与实践研究	2	36	√	√			考试	必修	所有方向
	00002102	自然辩证法概论	1	18	√	√			考试	必修，二选一	
	00002103	马克思主义与社会科学方法论	1	18	√	√			考试		
	00002104	综合英语（一）	2	36	√				考试		
	00002105	综合英语（二）	2	36		√			考试		
	00002106	学术英语（一）	2	36	√				考试		
	00002107	学术英语（二）	2	36		√			考试		
学位必修课程 14 学分	35102201	中级微观经济学	3	54	√				考试	必修	所有方向必修
	35102202	中级宏观经济学	3	54	√				考试	必修	
	35102204	中级计量经济学	3	54	√	√			考试	必修	
	35102203	数理经济学	3	54	√	√			考试	必修	
	35632206	论文写作指导	2	36			√		考察	必修	
学位选修课程 13 学分	35632329	金融工程专题	3	54		√	√		考试/论文	必选	所有方向必选
	35631301	金融经济理论与方法	3	54		√	√		考试/论文	必选	所有方向必选
	35631302	货币金融理论与政策	2	36		√	√		考试/论文	选修	所有方向必选
	35631304	金融风险管理理论与方法	2	36		√	√		考试/论文	选修	
	35642315	金融数学选讲	2	36		√	√		考试/论文	选修	
	35642310	保险精算	2	36		√	√		考试/论文	选修	
	35632319	国际金融	2	36		√	√		考试/论文	选修	

类别	课程编号	课程名称	学分	总学时	开课学期				考核方式	必修或选修	适应方向
					1	2	3	4			
学位 选修课程 13 学分	35632318	商业银行经营与管理	2	36		√	√		考试/论文	选修	
	35632328	公司金融专题	2	36		√	√		考试/论文	选修	
	35631303	家庭金融理论与方法	2	36		√	√		考试/论文	选修	
	02021202	高级微观经济学	3	54			√		考试	选修	
	02021201	高级宏观经济学	3	54			√		考试	选修	
	02021203	高级计量经济学 I	3	54			√		考试	选修	
	02021304	高级计量经济学 II	2	36		√			考试	选修	
	35632330	国家金融学	1	18		√	√		考试/论文	选修	
教学实践与科学训练	35632601	教学实践、实习与科研训练	1					√	考查	必选	
前沿讲座	35632701	金融学前沿讲座	2					√	考查	必选	

六、培养环节

1. 培养计划。硕士生入学 3 个月内必须依据本“基本要求”和各学科的最新硕士生培养方案制定出个人培养计划。培养计划要由导师、导师组和研究生共同商定。培养计划根据硕士生的不同基础，研究方向，按因材施教的原则对专业必修课和选修课或补修课程、文献综述、开题报告、中期考核、参加教学、实践活动、科学研究及论文撰写等做出可行的具体安排。

2. 文献综述。通过阅读大量的中外文文献，了解本学科或本研究方向国内、国外研究进展以及存在的问题，并进行综合分析写出一篇文献综述。要求：① 字数至少 5000 字；要求文字精练通顺，条理分明。② 中外文参考文献应分开。③ 在开题报告前完成，由导师负责评分，并写出评语。

3. 开题报告。本专业硕士生在第三学期进入论文选题阶段，并在第三学期末完成开题报告。开题报告应包括文献综述、研究目的意义、主要研究内容、实验方法及技术路线、工作特色及难点、预期成果及可能创新点等。开题报告应在（金融学）二级学科范围内相对集中、公开地进行，并由以本专业硕士生导师为

主体组成的考核小组评审。开题报告会也吸纳相关专业教师和研究生参加，跨学科的论文选题应聘请相关学科的导师参加。若学位论文课题有重大变动，应重新做选题报告，以保证课题的前沿性和创新性。评审通过的开题报告，应以书面形式交院审批后备案。在开题之前，硕士研究生必须阅读完规定的著作和专业文献，并通过考试。考试未获得通过者必须延迟论文开题。

4. 中期考核。硕士生的中期考核一般在第四学期内进行，由硕士生所在的学科点统一组织。并由学科负责人、导师及专家组成中期考核小组，对研究生思想品德、文献综述、开题报告、学习成绩、科研能力及健康状况进行全面考核。最后由研究生处审核后备案。考核合格者继续论文工作；对于学习成绩特别优秀、科研能力突出者给予奖励；不合格者按照学籍管理条例办理。

5. 科研、学术活动。为拓宽研究生的学术视野，促进研究生关注和了解学科前沿的发展，各学科专业要为硕士研究生举办高水平的学术报告、开展学科前沿讲座、开设文献阅读课等。要求每名硕士生听取学术报告不少于 10 次，公开做学术报告不少于 1 次，至少撰写专业文献综述 2 篇。达到此要求方可获得相应学分。

6. 实践活动。本专业的实践活动包括金融实践与社会实践两部分。其中，金融实践活动安排在第三学期，由两名指导教师带队，进行地方经济发展问题的专题调研，为期一周，并撰写调研报告与实习报告。实习活动结束后，指导教师给予相关评价，评价合格后方可获得相应学分。社会实践部分采用学生自选主题与自组织进行。

7. 论文答辩、学位授予按照国家和学校的有关规定执行。

七、培养方式

1. 研究生培养以课程学习、自主学习及参与科研活动为主要培养方式。自主学习要求研究生在读期间，除自己查阅与所开课程及本专业相关的参考资料外，还必须完成指定的经典文献阅读的任务。参与科研活动，主要是在导师指导下，参加导师正在进行的课题研究、论文写作等科研活动。

2. 研究生教学形式将灵活多样，提倡采用研讨班、专题式、启发式等多种教学方法，把课堂讲授、交流研讨、案例分析等有机结合，加大对研究生创新能力的培养。

3. 培养方式采取导师负责与导师组集体培养相结合的方法。导师是研究生培养的第一负责人，每个研究生导师组由 3-5 人组成，配合导师，充分发挥集体培养优势。

4. 对研究生的论文开题报告、论文工作检查等研究生教育的重要环节，由导师组集体讨论。

5. 导师要因材施教，教书育人，严格要求，全面关心研究生的成长，要定期了解研究生的思想状况、学习和科研状况，并及时予以指导帮助。