

金融学专业硕士研究生培养方案（020204）

一、培养目标

本专业培养具备应用经济学科的基础理论知识和本专业知识，系统掌握金融专业知识和相关研究方法，能满足金融机构、政府部门和企事业单位需求、具有健全人格、良好的心理素质和创新精神、合作精神的复合型人才。

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和本专业知识；掌握常用的研究方法和研究手段；熟悉金融数据处理，能够使用各种常用的计算机软件程序，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：应能基于管理实践和理论思考，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. 金融理论与政策
2. 商业银行经营管理
3. 金融投资与风险管理
4. 票号与金融史
5. 保险理论与实务

四、课程设置（见附表 1）

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〔2019〕26 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

学位论文基本要求参照《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〔2019〕26 号）中“第五章 硕士学位（毕业）论文”要求执行；撰写格式按照《山西财经大学研究生学位论文写作模板（2019 版）》执行。

七、本专业主要文献（见附表 2）

附表 1: 应用经济类

金融学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	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	金融理论与政策研究	2	32	2	金融学院	10 学分	
		商业银行经营管理研究	2	32				
		国际金融研究	2	32				
		金融投资研究	2	32				
		实证金融方法	2	32				
	选修课	专业方向选修课	金融风险管理	1	16	3	金融学院	2 学分
			金融经济学	1	16			
			票号与金融史研究	1	16			
保险理论研究			1	16				
任意选修课		普惠金融专题研究	1	16			4 学分	
		金融监管研究	1	16				
		金融政策与经济转型专题研究	1	16				
		政策性金融专题研究	1	16				
		金融伦理研究	1	16				
		中国货币史专题研究	1	16				
晋商票据解读	1	16						

	民国公司金融专题研究	1	16	3	金融学院	
	财务报表分析	1	16			
	信托与租赁	1	16			
	金融理财专题研究	1	16			
	金融衍生品定价研究	1	16			
	固定收益证券	1	16			
	行为金融研究	1	16			
	金融市场微观结构研究	1	16			
	R 语言与金融数据分析	1	16			
	金融学术论文写作指导	1	16			
	互联网金融专题	1	16			
	金融衍生工具应用及风险案例	1	16			
	在导师指导下选修其它学科的方法论课程。			1-3	相关学院	
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

注：补修课，不计学分。

附表 2:

本专业主要文献

序号	书名/期刊	著者	出版社	出版年份	选/必读
1	金融学	博迪	中国人民大学出版社	2018	必读
2	货币金融学	米什金	中国人民大学出版社	2016	必读
3	投资学	博迪	机械工业出版社	2017	必读
4	商业银行管理	罗斯	机械工业出版社	2013	必读
5	风险管理与金融机构	约翰·赫尔 (John, C., Hull)	机械工业出版社	2018	必读
6	公司金融理论	让·梯若尔	中国人民大学出版社	2015	必读
7	国际金融	保罗·R·克鲁格曼 茅瑞斯·奥伯斯法尔德	中国人民大学出版社	2016	必读
8	金融学文献通论	陈雨露、汪昌云	中国人民大学出版社	2006	必读
9	金融学	黄达	中国人民大学出版社	2017	必读
10	Analysis of Financial Time Series (3 rd Edition)	Tsay	John Wiley & Sons	2005	必读
11	中国金融史	姚遂	高等教育出版社	2007	选读
12	文明的冲突与世界秩序的重建	塞缪尔·亨廷顿	新华出版社	2018	选读
13	Paul Wilmott Introduces Quantitative Finance	Wilmott P.	John Wiley & Sons	2007	选读
14	Portfolio Selection	H. Markowitz	Journal of Finance, 12(7), 77-91	1952	选读

15	The Cost of Capital, Corporate Finance and the Theory of Investment	F. Modigliani and M. Miller	American Economic Review, 48	1958	选读
16	Capital Asset Prices: A Theory of Market Equilibrium under Condition of Risk	William Sharpe	Journal of Finance, 19	1964	选读
17	Efficient Capital Markets: A Review of Theory and Empirical Work	Fama, E.F.	Journal of Finance 35, 383-417	1969	选读
18	The Pricing of Options and Corporate Liabilities	F. Black and M. Scholes	Journal of Political Economy, 81(3)	1973	选读
19	Foundations of Financial Economics	Huang, C., and R. Litzenberger	Elsevier	1988	选读
20	任课教师所列课程大纲的推荐书目及导师所列推荐书目				
21	期刊： American Economic Review Econometrica Journal of Financial and Quantitative Analysis Journal of Financial Economics Journal of Finance Journal of Political Economy Journal of Econometrics Journal of Trading Mathematical Finance 经济研究 金融研究 经济学季刊 国际金融研究				