

西南财经大学

博士研究生培养方案

一级学科名称 应用经济学

二级学科名称 金融工程 (Financial Engineering)

二级学科代码 0202Z2

所属学院 金融学院

西南财经大学博士研究生培养方案

一、培养目标

金融工程是研究金融产品设计、定价与风险管理的学科。它融合现代金融学、工程方法和信息技术于一体，通过设计各种创新性金融工具方案（产品）来解决各种金融问题，是一门新兴交叉性学科。无套利定价与风险中性定价是金融工程典型的分析方法。培养目标：本学科致力于培养具有较高政治思想素质，掌握科学世界观与方法论，德智体全面发展，努力为建设中国特色社会主义服务的高层次专业人才。

博士学位获得者具有坚实宽广的经济学科理论基础与专业知识，具备宽广的国际视野，系统掌握相关领域的前沿专业文献；跟踪学术前沿，深入了解国内外相关领域最新研究动态，能够创造性地提出新问题、新观点、理论、方法或创新性地利用最新研究成果解决重要的实际问题；具备较强的国际交流能力，能够独立从事应用经济学的教学工作；具备在相关领域独立从事学术研究的能力。

二、培养方式

1. 培养方式

博士生的培养以科学研究工作为主，着重培养博士生独立从事科学研究的能力，学会进行创造性科学研究工作的方法和培养严谨的科学作风。根据培养目标的要求，分别设置几门基础理论课程和专业课程，通过学习，使博士生具有坚实的理论基础和系统宽广的专业知识，了解和掌握本学科的最新的研究动态和前沿问题。

博士生的培养采取导师负责和集体指导相结合的方式。导师负责博士生主要专业课的讲授、博士论文的具体指导；博士指导小组协助导师工作，主要参与博士生的中期考评、开题报告和部分专业选修课的讲授。

2. 个人培养计划

博士研究生应根据“博士研究生培养方案”，在学院组织下完成“个人培养计划”的制定。

三、学习年限

学校实行弹性学制，本专业博士研究生基本学习年限为 3 年，最长不超过 6 年。提前毕业条件按《西南财经大学研究生提前毕业管理办法》执行。

四、授予要求与授予学位

本专业普通博士研究生在攻读博士学位期间须至少修满 51 学分，其中课程学分不低于 31 学分。学分结构详见下表：

| 培养环节及最低学分要求 | 具体内容 | 类型 | 学分要求 |
|---------------|--------------------------|-------|--|
| 课程学习 31 学分 | 必修课 | 公共必修课 | 4 学分 |
| | | 学科基础课 | 9 学分 |
| | | 专业必修课 | 6 学分 |
| | 选修课 | 专业选修课 | 选修课学分不低于 12 学分，其中专业选修课学分不低于 12 学分。且脱产博士生不得选《中外金融体制与金融改革比较研究》课程 |
| | | 公共选修课 | |
| 中期考核 2 学分 | | | 2 学分 |
| 科研训练 6 学分 | 主讲专题学术报告 (含学术道德与学术规范) | | 2 学分 |
| | 学期/学年论文 | | 2 学分 |
| | 发表学术论文 | | 2 学分 |
| 实践环节 2 学分 | | | 2 学分 |
| 学位论文 10 学分 | 文献综述与开题报告 | | 2 学分 |
| | 完成学位论文 (通过预答辩及答辩) | | 8 学分 |

各博士研究生完成以上规定环节，且达到各环节最低学分要求，符合学位授予条件，将授予经济学博士学位。

1. 课程学习

金融工程专业博士研究生课程设置

| 课程类型 | 课程名称 | Course | 学分 | 学 期 | | | | 周学时 | 授课学院 (中心) | 备注 | |
|-----------------|------------------------|---|---|-----|----|-----|----|-----|-----------------|--------------|---|
| | | | | I | II | III | IV | | | | |
| 必修课 | 公共必修 | 中国马克思主义与当代 | 2 | √ | | | | 2 | 马克思主义学院 经济学院 | 2 选 1 | |
| | 学术英语写作 | Academic Writing in English | 2 | | √ | | | 2 | 经贸外语学院 | | |
| | 经济英语文献阅读 | Economics Literature in English | 2 | | √ | | | 2 | 经贸外语学院 | | |
| | 学科基础 | 高级计量经济学 (I) | 1.5 | √ | | | | 4 | 统计学院 | 应修满 9 学分 | |
| | 高级计量经济学 (II) | Advanced Econometrics (II) | 1.5 | √ | √ | | | 4 | 统计学院 | | |
| | 高级微观经济学 | Advanced Microeconomics | 3 | √ | | | | 6 | 经济学院 | | |
| | 高级宏观经济学 | Advanced Macroeconomics | 3 | √ | | | | 6 | 经济学院 | | |
| | 专业必修 | 金融经济学 | Financial Economics | 3 | √ | | | | 3 | 金融中心 金融学院 | 应修满 6 学分 |
| | 高级金融计量分析 | Advanced Financial Econometrics | 3 | | √ | | | 3 | 金融学院 | | |
| | 选修课 | 金融资产定价 | Financial Asset Pricing | 3 | | | √ | | 3 | 金融学院 | 选修课 学分不 低于 12 学分, 其 中专业 选修课 学分不 低于 12 学分。 |
| 金融风险管 | | Financial Risk Management | 3 | | | √ | | 3 | 金融学院 | | |
| 金融衍生产品与交易策略 | | Financial Derivatives and Trading Strategies | 3 | | | √ | | 3 | 金融学院 | | |
| 资本市场研究 | | Capital Market Studies | 3 | | √ | | | 3 | 金融学院 | | |
| 计算金融 | | Computational Finance | 3 | | √ | | | 3 | 金融学院 | | |
| 中外金融体制与金融改革比较研究 | | Comparative studies of Financial System and Financial Reform of China and Foreign Countries | 3 | | √ | √ | | 3 | 金融中心 金融学院 | | |
| 公共选修 | | 马克思主义经典著作选读 | Selected Reading of Marxist Classic Works | 2 | | √ | | | 2 | 马克思主义学院 | |
| 其他博士点所开课程 | Other optional courses | | 2 | | | | | | | | |

说明：公共必修课中的英语课程免修条件详见《西南财经大学非英语专业研究生公共外语课程免修免考说明》。

2. 中期考核

博士研究生的中期考核按照《西南财经大学博士研究生中期考核管理办法（试行）》执行。

3. 科研训练

博士研究生应在论文答辩申请前完成科研训练。其中主讲学术报告至少 4 次，2 个学分；发表学术论文 2 个学分。

各培养单位应要求博士研究生在第一至第四学期在导师的指导下撰写完成学期学年论文 4 篇，达到规定要求可获得 2 个学分。

4. 实践环节

博士研究生应在论文答辩申请前完成社会实践与教学实践，2 个学分。具体要求见《西南财经大学研究生社会实践管理办法》。

5. 学位论文

1. 学位论文的时间和工作量要求

博士研究生应在第三学期或第四学期完成文献综述和学位论文开题工作，2 个学分。

学位论文 8 个学分。从论文开题至论文答辩申请前，工作时间不得少于 12 个月。

博士研究生的学位论文定稿前，应对其进行预答辩。

2. 学位论文形式与格式的要求见《西南财经大学关于研究生学位论文形式与格式的基本要求》。

五、参考文献

本专业博士研究生文献阅读经典著作书目、专业学术期刊目录、经典论文篇名表：

| 序号 | 著作或期刊的名称 | 作者 | 出版社 | 出版或发表时间 | 必读或选读 |
|----|------------------|-----------------------------|----------------------------|---------|-------|
| 1 | 衍生金融工具 | John Hull | Wiley | 2015 | 必读 |
| 2 | 金融风险管理 with 金融机构 | John Hull | Wiley | 2015 | 必读 |
| 3 | 金融计量学 | John Campbell and Andrew Lo | Princeton University Press | 1996 | 必读 |
| 4 | 金融随机过程 | Steven Shreve | Springer | 2010 | 必读 |

审核人：赵静梅