

# 南京大学工程管理学院金融硕士（0251）培养方案

(Master of Finance, MF)

(2021年5月修订)

## 一、专业学位类别介绍

金融硕士属于专业学位类别，类别代码：0251，英文名称为：Master of Finance, MF。

## 二、培养目标

本专业紧跟国家重大战略与中国金融改革方向，在信息化、智能化、数字化时代背景下，面向资本市场与商业银行两大系统，应用金融科技手段，针对服务实体经济、防控金融风险、深化金融改革，提升人才培养的社会需求、行业需求适应性定位。坚持培养掌握马克思主义基本原理、中国特色社会主义理论体系和习近平新时代中国特色社会主义思想，具有良好的金融伦理和职业道德，经济金融理论基础扎实，精通专业领域知识与方法，聚焦微观金融运行，依托金融逻辑与算法实现，能够从事企业投融资决策、风险管理、定量研究以及金融信息技术等方面工作的富有创新精神的复合型高级金融工程与金融管理人才。

## 三、研究方向

研究方向一：金融工程。紧跟国家重大战略与金融市场改革方向，以一系列的现代金融理论作为基础，运用一定的金融技术，研究和解决特殊问题，满足金融市场上特定的风险规避和效率提高需求，产生创新性的金融产品和创造性的解决方案。

研究方向二：金融机构与运作。聚焦围观金融运行，依托金融逻辑与算法，研究金融机构的投融资决策、风险管理等等，力图创新性解决解决金融机构管理与运营过程中存在的现实金融问题。

## 四、学习年限

本类别专业学位硕士研究生的基本修业年限为3年，最长修业年限（含休学和保留学籍）为4年。

## 五、课程设置

本专业硕士课程设置，遵循由职业价值与伦理、理论知识、专业技能组成三维系统金融硕士能力框架，构建“公共课+基础课+专业必修课+专业选修课+实践”的课程体系。课程采用课堂讨论、翻转课堂、工作坊、案例分析、专题讲座、国外访学、国际化课程等形式，注重提升实践类课程比重、贴近金融市场真实场景，注重强化和国际一流高校合作、塑造学生国际化视野。

本专业硕士研究生每年秋季入学，学制为3年。攻读金融专业硕士专业学位的研究生，在学期间应修满37学分。（1）课程环节：课程学习1年半；A类（校公共课，含金融伦理课程）9学分，B类（专业基础课、金融教指委核心课）9学分，C类（专业实践课、金融教指委选修课）10-14学分，D类（金融教指委选修课）与专业实习4学分。根据当年计划，暑假安排学生赴牛津大学完成5门短期课程学习。（2）实践环节，4学分：通过与金融监管机构、金融企业、地方政府共建的省级研究生工作站、实习基地与平台，依托双导师制度，紧贴社会、行业、企业现实需求，通过企业实践、项目实践、或结合课程学习、学位论文等形式，开展实践学习；（3）毕业设计环节：学位论文1年，学位论文不计学分。学习成绩优异者可按照学院的有关规定，提前半年或一年毕业。

## 六、培养环节

### 1、师生互选、中期考核等环节规则

金融专业硕士入学后一个月内，进行师生双向互选，确定校内导师和业界导师，实行双导师制培养。在导师的指导下制定培养计划，经学院审核批准后，送研究生院备案。聘请业界知名人士作为实践导师，为学生提供从理论指导、专业实践到未来职业生涯设计的全面指导。校公共课程和院公共课程以讲授为主，辅以自学。专业必修课程和选修课程则采取讲授和自学相结合的形式，课堂教学为主，兼有案例分析。

根据《南京大学研究生学业奖学金实施暂行办法》（南字发[2014]105号）、

南京大学《2019年研究生学业奖学金评定工作通知》、《工程管理學院2019—2020年度研究生獎學金評審辦法》文件精神，採取導師評分與同行教師評分並行的方式，對金融專業碩士研究生進行中期與年度考核。

## 2、講座報告、學術實踐等環節要求

(1) 要求學生在校期間積極參加各種有關的學術活動，深入志願服務等社會實踐，參加導師的有關課題研究。參考國外學校的 Seminar 形式，學生組成學習小組，共同討論、設計和開發新的金融產品，讓學生能自由自主地、創造性地學習和發展。請學界與業內人士定期開展講座或授課，講授熱點問題，進行案例教學模式，並提出問題與學生一起研討。

(2) 強化立德樹人，構建職業道德和倫理教育體系，專設兩門倫理教育課程，同時主干課程全面融入道德倫理、職業操守教育內容，確保流程全覆蓋、課程全嵌入，具體如下：

- 專門開設倫理課程：專任教師開設《金融倫理學》和《工程倫理》（含金融技術倫理），進行職業道德與倫理的系統介紹和教育。
- 專業課程融入倫理教育：《金融理論經典與前沿》，帶領學生梳理、精讀金融領域經典和前沿文獻，並結合金融市場交易制度設計與評估、交易所籌建方案等課題，講解金融如何回歸初心，以金融創造好的社會為終極目標，提升整合社會福利。在《期權交易理論與實務》、《期貨理論與實踐》課程中，由上交所、上期所及其會員單位專家親授金融工程服務實體經濟成功案例，樹立職業榜樣。《金融市場與機構》、《金融工程學》等課程中通過穿插實踐案例，培養學生敬畏市場、敬畏法治、敬畏專業、敬畏風險的職業操守。
- 企業實訓融入倫理教育：加強基地育人，採用“走出去”模式，在农村商業銀行等金融機構實訓中培養學生職業操守。

## 七、專業實踐

1、採用全脫產在校學習與企業實踐相結合的培養方式。在1年半內基本修完全部課程；企業實習時間從第四學期開始。根據金融碩士教指委規定，金融專業碩士研究生累計實習實踐教學時間不少於6個月。在校外專業實踐的前中後環

节中，学院学工教师、研究生导师要对本专业研究生，进行安全方面的教育与检查。

2、专业实习学分的认定以研究生提供的实习证明、实习报告为依据。实习证明、实习报告主要考核研究生的实践能力(基本素养、组织能力、协调能力、合作精神和创新意识等，需加盖实习单位评语、评分和公章。

3、毕业论文研究要以解决企业生产实际问题和具有实际应用背景的选题为主。论文指导一般应根据研究方向实行双导师制(其中一位来自对口行业)，或成立由学校教师和行业专家组成的指导小组。

## 八、学位论文

本专业学位论文选题来源于应用课题或现实问题，有明显的职业背景和行业应用价值，旨在解决某一特定组织(如金融企业)或某一特定行业(如金融服务业)的问题，体现出前瞻性、实践性和创新性，运用所学知识与方法解决实际工作中的问题，提高学生发现、分析、解决问题的能力。

### 1、学位论文基本要求

(1) 金融专业硕士学位论文可以将金融案例分析、金融策略研究报告、金融实践问题解决方案与调研报告、金融产品方案设计、金融政策分析、行业研究报告等作为论文形式，予以呈现，具体如下：

- **金融案例分析：**运用专业理论，结合中国金融改革和发展的实践，以中国金融运行中的出现的典型性事件、活动或产品等作为研究对象，进行深入分析或解释某一问题(包含理论问题)，可以采用单案例分析或者多案例分析；应重视典型性、新颖性、重要性、务实性，要有理论与应用的分析价值，并总结出带有普遍性的认知结论。
- **金融策略研究报告：**基于金融市场中金融投资、金融管理等现实情景，关注金融机构、非金融机构以及个人和家庭等为关经济主体，针对投资交易策略(模型)、风险或成本优化管理策略(方案)、项目投资决策、激励问题，以及金融企业的业务条线优化等问题，历经模型和策略的设计、开发、评估及其计算机实现，并对对该策略的适用性和应用前景进行评估。

- **金融实践问题解决方案与调研报告：**强调金融实践，可以结合实习单位所面临之实际问题的调研需求，对某一具体金融实践问题展开客观深入的调查基础上，对该问题产生的过程、现状、问题及原因进行符合经济学、金融学逻辑的分析与探讨，并分析该问题的潜在影响，提出对策建议。为相关部门预判或评价政策效果提供微观证据。
- **金融产品方案设计：**针对金融现实问题提出一种创新性或创造性的合约安排或解决方案。以全新金融产品或金融交易机制，或者是已有的新型金融产品或金融交易机制为研究对象，探讨其的功能、收益和风险特征，并具有实际应用前景。
- **金融政策分析：**结合中国金融改革和发展的实践和政策，以中国金融运行中出现的基本金融问题等作为研究对象，对金融问题的经济效应、驱动因素及政策实施效果等进行深入分析，为金融机构决策层提供优化行业配置、资产配置等方面的策略参考，也可以为金融管理当局提高政策效果提供微观证据和设计思路。
- **行业研究报告：**以发展逻辑清晰、发展前景广阔、符合国家产业发展政策要求的行业，及行业内具有核心竞争力的公司为研究对象，开展客观深入的分析及必要调研，并对行业未来竞争发展趋势，以及行业内重点公司进行价值分析，为经济主管部门、企业、投资机构的判断和决策依据。

(2) 金融专业硕士学位论文强化应用导向，其文献综述、理论构建等模型的使用等不作硬性要求，方法上不限于数理金融、数值计算、计量经济学模型、金融仿真等定量化分析工具，则更多地鼓励其多样性，比如采用企业调研、案例等多种分析方法。

## 2、论文开题、中期和评阅评审要求

(1) 硕士生开题考核规则如下：

- 第三学期9月份，论文开题评审工作启动。
- 各教研室根据导师提交的论文开题延期名单，对符合论文开题要求的学生组织开题评审工作（包括同行评审与现场答辩）。
- 开题延期的学生与首轮开题答辩不通过的学生由导师自行组织二次评



评审。

- 中期二次评审结果必须在第五学期结束前提交给研究生秘书，未通过中期评审的学生无资格参加学位论文答辩。

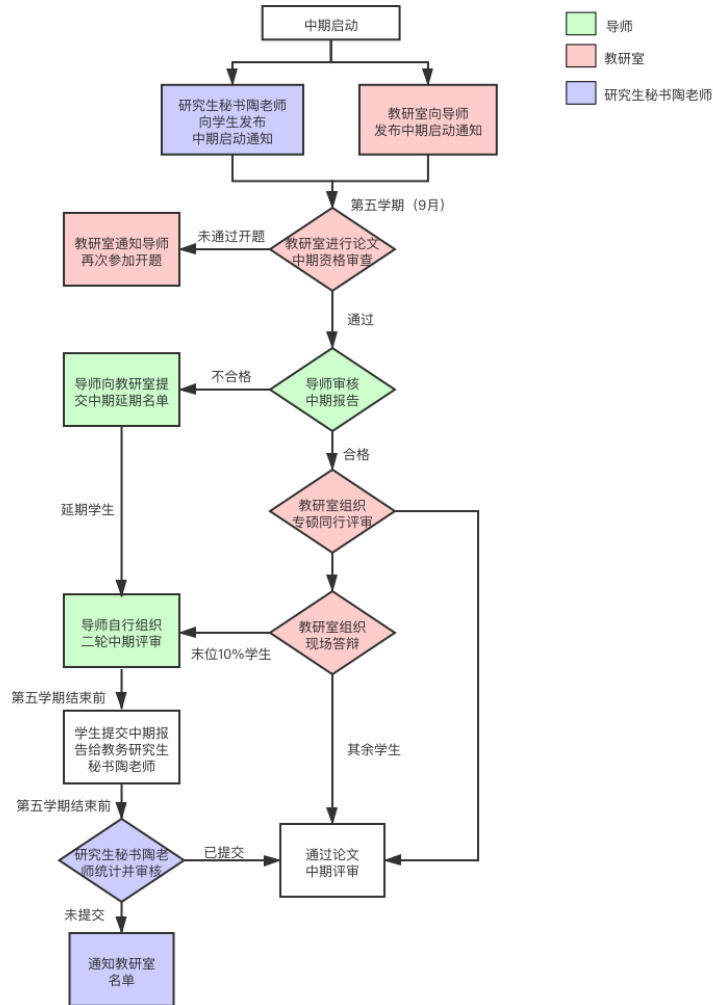


图 2：论文中期管理流程

## 九、答辩和学位授予

金融专业学位硕士研究生完成培养方案中规定的所有环节，修满规定学分，才可获得论文答辩资格。硕士论文答辩委员会由 3-5 名具有硕士研究生导师资格的成员组成，实行导师回避制度。至少有 1 位来自相关实务部门且已取得硕士及以上学位的行业专家。论文答辩会由论文答辩委员会主席主持。

修满规定学分、完成专业实习并通过学位论文答辩者，经学院学位评定分委

员会审查、表决，报校学位评定委员会审议通过后授予硕士专业学位。硕士论文答辩具体流程如下：

- 第六学期 2-3 月份，论文答辩准备工作启动。
- 教研室首先根据中期评审结果进行论文答辩首轮资格审查，未通过中期评审的学生延期答辩。
- 导师审核论文，并提交具有签名的导师意见，方能进入查重环节，否则延期答辩。
- 查重通过的论文进入盲审环节，否则延期答辩。
- 盲审与内审均通过的论文方能进入首轮答辩，否则延期答辩。
- 首轮答辩不通过的论文参加二次答辩，二次答辩仍不通过者延期答辩/毕业。

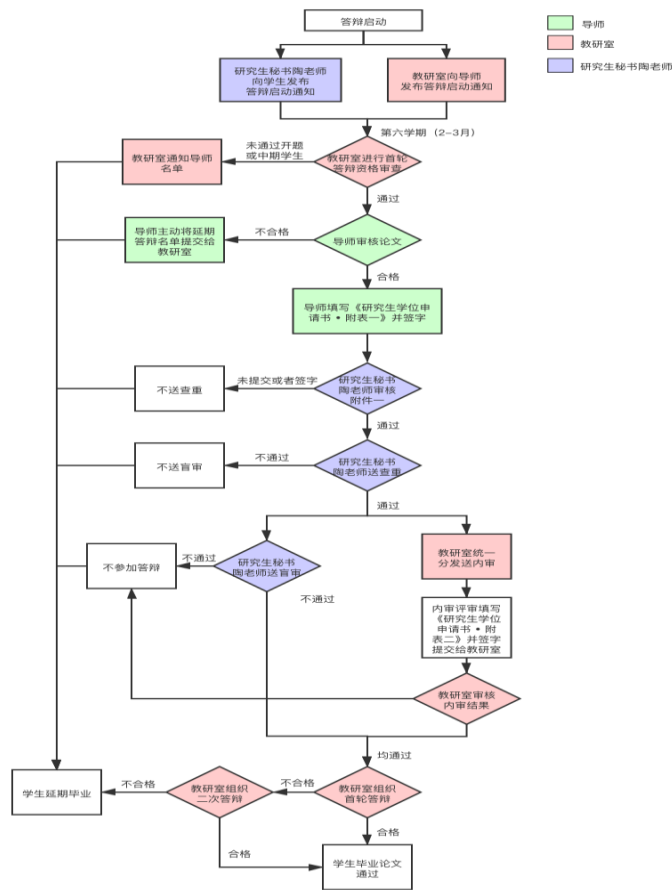


图 3：论文答辩管理流程



附表： 课程设置

课程类别	课程代码	课程名称	学分	总学时	开课学期	是否必修	备注	教学用书
A类	10284A001	英语	4	64	第一学期	必修		
A类	10284A004	自然辩证法概论	1	16	第二学期	必修		
A类	10284A002	中国特色社会主义理论与实践研究	2	32	第一学期	必修		
A类	10284A006	金融伦理	2	32	第二学期	必修		
A类	10284A030	研究生学术规范与学术诚信	-	-	每学期	必修	第一年内修完	
B类	0251B002	金融市场与金融机构 Financial Markets and Institutions	2	32	第二学期	必修	肖斌卿 李心丹	金融市场与金融机构
B类	0251B001	投资学 Investments	2	32	第一学期	必修	朱洪亮	投资学
B类	0251B003	公司金融 Corporate Finance	3	48	第二学期	必修	陈莹	公司金融学
B类	0251B004	金融衍生工具 Financial Derivative Instruments	2	32	第一学期	必修	刘海飞	金融衍生产品——衍生金融工具理论与应用
C类	0251C007	财务报表分析 Analysis of Financial Statements	2	32	第二学期	选修	王国俊	
C类	0251C011	牛津大学5门短期课程 (1) Price Impact Models and Optimal Trade Execution; (2) Numerical PDEs; (3) Monte Carlo; (4) Financial Data Analysis; (5) Behavioral Finance	3	48	暑期	选修	牛津大学教授 (赴牛津学习)	
C类	0251C001	高级计量经济学 Advanced Econometrics	3	48	第二学期	选修	方立兵	
C类	0251C006	期权交易理论与实务 Theory and Practice of	2	32	第一学期	选修	杨学伟	

		Trading						
C类	0251C005	固定收益证券 Fixed Income Securities	2	32	第二学期	选修	李心丹 李昊骅	
C类	0251C004	行为金融学 Behavioral Finance	2	32	第二学期	选修	俞红海	
C类	0251C003	金融风险管 Financial Risk Management	2	32	第二学期	选修	刘焯	
C类	0251C002	应用随机过程 Applied Stochastic Processes	2	32	第一学期	选修	瞿慧	
C类	0251C009	期货理论与 Theory and Practice of Futures Market	2	32	第一学期	选修	方立兵	
D类	0251D001	金融理论经典与前沿 Classics and Frontiers of Financial Theory	3	48	每学期	选修	李心丹	
D类	1201B0200	系统方法与应用 Systems Approach and Application	2	32	第二学期	选修	周晶	
D类	1201B0100	最优化理论与方法 Optimization Theory and Method	2	32	第一学期	选修	徐薇	
D类	1201B0300	博弈论 Game Theory	2	32	第一学期	选修	肖条军	
D类	1201C1500	大数据分析技术与应用 Big Data Analytics Technology	2	32	第二学期	选修	刘帆	
D类		学术讲座	1	16	每学期	选修		
		企业实习	4	64	每学期	必修		
		毕业论文			每学期	必修		

注：研究生可通过参加学院论文写作主题讲座、选修学校院系开设的论文写作课程等方式强化论文写作学习。