八、经典阅读书目及期刊目录

**（1）专著**

[1] 滋维·博迪等. 投资学（原书第9版）[M].北京：机械工业出版社，2014.

[2] 斯蒂芬A.罗斯等. 公司理财（原书第9版）[M].北京：机械工业出版社，2012.

[3] 赫尔等. 期权、期货及其他衍生产品（原书第9版）[M].北京：机械工业出版社，2014.

[4] 弗兰克·J·法博齐. 固定收益证券手册（原书第7版）上下册[M].北京：中国人民大学出版社，2014.

[5] 保罗·威尔莫特.保罗·威尔莫特数量金融[[1]](#footnote-1)系列:数量金融(原书第2版)(第1-3卷) ][M].北京：机械工业出版社，2015.

[6] 戴维·斯托厄尔.投资银行、对冲基金和私募股权投资[M].北京：机械工业出版社，2013.

[7] 乔舒亚·罗森鲍姆等.投资银行:估值、杠杆收购、兼并与收购(原书第2版)[M] .北京：机械工业出版社，2014.

[8] 埃塞姆·阿培丁.机器学习导论（原书第3版）[M].北京：机械工业出版社，2016．

[9] 米什金. 货币金融学（原书第9版）[M].北京：中国人民大学出版社，2011.

[10] 彼得 S.罗斯等. 商业银行管理（原书第9版）[M].北京：机械工业出版社，2013.

[11] 庹国柱. 保险学(第7版)[M].北京：首都经济贸易大学出版社，2016.

[12] 弗兰克.J.法博齐. 金融市场与金融机构基础（原书第4版）[M].北京：机械工业出版社，2010.

[13] 保罗·R·克鲁格曼. 国际金融（原书第10版）[M].北京：中国人民大学出版社，2016.

[14] 米尔顿•弗里德曼. 美国货币史（1867-1960）[M].北京：北京大学出版社，2009.

[15] 理查德C.格林诺德等. 主动投资组合管理:创造高收益并控制风险的量化投资方法(原书第2版) [M].北京：机械工业出版社，2014.

[16] 蔡瑞胸.金融时间序列分析（原书第3版）[M].北京：人民邮电出版社，2012.

[17] 陈强.高级计量经济学及Stata应用（第2版）[M].北京：高等教育出版社，2014.

[18] 范剑青、姚琦伟.计量金融精要（英语）[M]. 北京：科学出版社有限责任公司，2016.

[19] Cheng-Few Lee,John Lee.Handbook of Quantitative Finance and Risk Management, Vol I[M].German:Springer,2010.

[20] Bernd Scherer, Kenneth Winston. The Oxford Handbook of Quantitative Asset Management[M],UK:Oxford Press,2014.

[21] John Guerard. Handbook of Portfolio Construction: Contemporary Applications and Markowitz Techniques[M],German:Springer,2014.

[22] Y.Ait-Sahalia.Handbook of Financial Econometrics Vol I and Vol II[M], German:Elsevier Science Ltd,2009.

[23] Lee,Chen-Few,John C. Handbook of Financial Econometrics and Statistics[M],German:Springer,2014.

[24] George M.Constantidides, Milton Harris and Rene Stulz. Handbook of the Economics of Finance Vol I and Vol II[M],German:Srpinger,2003.

[25] John H.Cochrane.Marco-finance, NBER Working Paper No.22485[R], Aug 2016.

[26] John H.Cochrane. Asset Pricing: Revisited Edition[M],US: Princeton University Press,2005.

[27] Turan G.Bali.Robert F.Engle,Scott Murray. Empirical Asset Pricing: The Cross Section of Stock Returns[M],US:Wiley,2016.

**（2）期刊**

[1]经济类，世界经济.

[2]管理类，管理世界.

[3]经济类，经济研究.

[4]经济类，中国工业经济.

[5]经济类，世界经济与政治.

[6]经济类，国际金融研究.

[7]经济类，数量经济技术经济研究.

[8]经济类，金融研究.

[9]经济类，经济学动态.

[10]经济类，经济理论与经济管理.

[11]经济类，财贸经济.

[12]管理类，管理科学学报.

[13]经济类，American Economic Review

[14]经济类，Quarterly Journal of Economics

[15]经济类，Journal of Political Economy

[16]经济类，Econometrica

[17]经济类，Journal of Finance

[18]经济类，Journal of Financial Economics

[19]经济类，Journal of Financial and Quantitative Analysis

[20]经济类，Quantitative Finance

[21]经济类，Journal of Computational Finance

[22]经济类，Journal of Financial Econometrics

[23]经济类，Journal of Econometrics

[24]经济类，Journal of Mathematical Finance

[25]经济类，Journal of Derivatives

[26]经济类，Journal of Portfolio Management

[27]计算机科学类，Machine Learning

[28]计算机科学类，Journal of Machine Learning Research

[29]计算机科学类，Neural Computation

[30]计算机科学类，Pattern Recognition Letters

九、培养目标与毕业要求矩阵图

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **培养目标**  **毕业要求** | 树立核心社会主义价值观以及规范使用语言文字的意识和应用能力 | 具有国际视野，具有较强业务与科研素养 | 解决复杂金融投资问题的综合能力 | 能够胜任银行、证券、保险等金融机构、政府部门和企事业单位的专业工作要求 | 适应大数据与人工智能时代 | 融会贯通前沿和主流量化投资与金融知识的应用型和复合型人才 |
| 掌握马克思主义、毛泽东思想和中国特色社会主义理论体系 | H | M | M | H | H | H |
| 掌握投资学的基础知识和专业基础理论，熟悉金融学、统计学、计算机科学、经济学等学科原理与方法 | H | H | H | H | M | H |
| 能够应用投资学的基本原理、方法对本专业领域及相关领域问题进行分析、管理和研究 | H | H | H | H | H | H |
| 能够参加高水平国内外行业资格考试，具有国际视野 | H | H | H | H | H | H |
| 具有强烈的社会责任感，以及职业道德和个人修养 | H | H | M | H | M | H |

十、毕业要求与课程体系矩阵图

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **毕业要求**  **课程名称** | 掌握马克思主义、毛泽东思想和中国特色社会主义理论体系 | 掌握投资学的基础知识和专业基础理论，熟悉金融学、计算机科学等学科原理与方法 | 能够应用投资学的基本原理、方法对本专业领域及相关领域问题进行分析、管理和研究 | 能够了解投资与金融领域的有关方针、政策和法规以及国内外本学科的理论前沿和发展动态。 | 能够参加高水平国内外行业资格考试，具有国际视野 | 具有强烈的社会责任感，以及职业道德和个人修养 |
| 思想道德修养与法律基础 | √ |  |  |  |  | √ |
| 大学生心理健康 | √ |  |  | √ |  | √ |
| 毛泽东思想与中国特色社会主义理论体系概论 | √ |  |  |  |  | √ |
| 习近平新时代中国特色社会主义思想概论 | √ |  |  |  |  | √ |
| 马克思主义基本原理概论 | √ |  |  |  | √ | √ |
| 形势与政策 | √ |  | √ | √ |  | √ |
| 中国近现代史纲要 | √ |  |  |  | √ | √ |
| 大学英语Ⅰ、Ⅱ | √ |  | √ | √ | √ |  |
| 数学分析I | √ | √ | √ | √ | √ |  |
| 数学分析II | √ | √ | √ | √ | √ |  |
| 线性代数 | √ | √ | √ | √ | √ |  |
| 概率论与数理统计 | √ | √ | √ | √ | √ |  |
| 体育Ⅰ、Ⅱ、Ⅲ、Ⅳ | √ |  |  |  |  | √ |
| 人工智能导论 | √ | √ | √ | √ | √ |  |
| 应用写作 | √ |  | √ | √ |  |  |
| 军事理论 | √ |  |  |  |  | √ |
| 国家安全教育 | √ |  |  |  |  | √ |
| 人工智能素养 | √ | √ | √ | √ | √ |  |
| 金融学科导论 | √ | √ | √ | √ | √ | √ |
| 政治经济学 | √ | √ | √ | √ |  |  |
| 微观经济学 | √ | √ | √ | √ | √ |  |
| 金融学 | √ | √ | √ | √ | √ | √ |
| 宏观经济学 | √ |  |  | √ | √ | √ |
| 商业银行经营管理 | √ | √ | √ | √ | √ | √ |
| 公司金融（双语） | √ | √ | √ | √ | √ | √ |
| 投资学 | √ | √ | √ | √ | √ | √ |
| 国际金融学（双语） | √ | √ | √ | √ | √ | √ |
| 金融衍生工具（双语） | √ | √ | √ | √ | √ | √ |
| 投资银行学 | √ | √ | √ | √ | √ | √ |
| 量化金融学（双语） | √ | √ | √ | √ | √ | √ |
| 会计学 | √ | √ | √ | √ |  | √ |
| 统计学 | √ |  |  | √ | √ |  |
| 金融计量学 | √ | √ | √ | √ | √ | √ |
| 固定收益证券（双语） | √ | √ | √ | √ | √ | √ |
| 保险学 | √ | √ | √ | √ | √ | √ |

十一、课程修读及培养流程图

|  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **第一学年** | | **第二学年** | | **第三学年** | | **第四学年** | |
| **一** | **二** | **三** | **四** | **五** | **六** | **七** | **八** |

专业必修课

思想道德与法治、大学生心理健康

毛泽东思想与中国特色社会主义理论体系概论、习近平新时代中国特色社会主义思想概论

马克思主义基本原理概论；形势与政策

形势与政策

形势与政策、中国近现代史纲要

体育Ⅰ

体育Ⅱ

体育Ⅲ

体育Ⅳ

金融学科导论、政治经济学

专业必修课

专业选修课

数学分析I

线性代数。数学分析II

概率论与数理统计

第二课堂、创新创业教育；通识教育选修课；个性化选修

毕业实习及毕业论文（设计）

大学英语Ⅰ

大学英语Ⅱ

人工智能导论

人工智能素养

通识教育必修课

专业教育

应用写作

微观经济学

宏观经济学

金融学

国际金融学（双语）

公司金融（双语）

商业银行经营管理

投资学

保险学  
Insurance

金融计量学

会计学

投资银行学

量化金融学（双语）

军事理论

金融衍生工具（双语）

固定收益证券（双语）

统计学

1. 英文原文为“quantitative finance”，应翻译为“量化金融”。 [↑](#footnote-ref-1)