



# 2015 年上海财经大学统计与管理学院 应用统计专业硕士（金融投资与风险管理方向）招生简章

## 目 录

学科概况	1
学科带头人简介	2
项目背景	3
培养目标	3
培养方式	4
报考指南	4
招生对象	4
报名资格	4
考试方式	4
报名流程	5
录取方式	5
联系方式	5
考试大纲	5
附件 1：经济类专业学位联考综合能力考试大纲	5
附件 2：统计学考试大纲	7

## 学科概况

上海财经大学统计学科是一个历史悠久、成绩斐然的学科。作为上海财经大学最早设立的系科之一，统计学科始建于1946年，并一直延续至今。统计学科建立之初，云集了邹依仁、薛仲三、诸凤仪、金国宝、朱君毅、赵章甫、陈善林等一批著名教授，他们为本学科的建设奠定了坚实基础。1978年以后，统计学科在陈善林、郑德如、贾宏宇、胡国华、马家善、田竞和、黄树颜、郑菊生等众多教授的悉心培育和努力开拓下得到了迅速发展。1981年，本学科点经国务院学位委员会批准成为全国第一批统计学硕士学位授予点。自1981年起，本学科点率先招收应用统计研究生；1986年，本学科点由国务院学位委员会批准成为全国首批统计学博士授予点之一；1996年，本学科点又经国务院学位委员会批准成为全国最早的统计学博士后流动站之一；1997年，本学科点被评为国家财政部的统计学重点学科；2007年又被评为上海市重点学科；2009年，本学科本科专业被评为国家教育部的特色专业；2010年，本学科点由国务院学位委员会批准成为全国首批应用统计专业硕士授予点之一；2011年本学科经国务院学位委员会批准成为一级学科统计学博士授予点和一级学科统计学硕士授予点。2013年，本学科被上海市批准为追赶世界一流水平的“一流学科A”学科。

上海财经大学统计与管理学院现有教师45人，其中教授10名，副教授21名，36名教师拥有博士学位；其中博士生导师33名（含兼职博导），硕士生导师34名，中组部“千人计划”专家3人，教育部长江学者2人，国家杰出青年基金获得者1人，国家优秀青年基金获得者1人，“新世纪百千万人才工程”国家人选1人，教育部新世纪优秀人才5人，上海市科技领军人才后备队1人，上海市“浦江人才计划”11人。经过不懈的努力，上海财经大学统计学科培养和建设了一支实力雄厚、结构合理的科研梯队，完成并发表了一批具有影响力的高质量学术科研成果。

上海财经大学统计学科依托于统计与管理学院，近年来努力开展国际化建设，依照国际标准建设和发展本学科。按照研究型大学的建设要求，结合上海财经大学的特点，本学院重点发展经济统计、数理统计、应用统计以及数量金融与风险管理等学科专业。本学院以“夯实数理基础、丰富方法体系、拓宽应用方向”为学科发展原则，形成了一批具有自身特色的优势学科方向。通过改革本科生和硕士生培养方案，完善统计学科的人才培养体系，采用国际通行教材，提供优质的教学服务等一系列举措，培养了大批优秀的复合型统计人才。

## 学科带头人简介

一流人才的培养是大学教育的最高目标，一流学科是培养一流人才的重要支撑，一流的师资是建设一流学科和培养一流人才的重要保障。本学院高度重视一流师资的引进和培育，尤其是具国际影响力的学科带头人的引进和培养。在学校的大力支持下，上海财经大学统计与管理学院已拥有一支卓越的学术带头人团队。他们是（按姓氏字母顺序）：



艾春荣  
长江学者、中组部千人计划  
应用统计学科带头人



陈晓红  
中组部千人计划  
应用统计学科带头人



黄坚  
中组部千人计划  
数理统计学科带头人



沈晓彤  
中组部千人计划  
应用统计学科带头人



徐国祥  
国务院特殊津贴专家  
经济统计学科带头人



周勇  
长江特聘教授、国家杰出青年  
金融统计与风险管理学科带  
头人

## 项目背景

根据上海金融领域“十二五”人才发展的规划，到2015年，上海建成国际金融中心所需的专业人才总量从2011年的23万增加到32万之多，《规划》预计：到2015年，具有本科及以上学历的人员比例达到70%，其中，研究生学历人才比例达15%。可见，金融领域缺乏高层次人才。大数据时代，金融领域出现的海量数据，需要大批不仅具备扎实经济、金融知识，又掌握先进的数据分析方法，且熟悉计算机技能的应用统计专业人才。市场对高层次复合型应用统计专业人才的需求是巨大的。

作为国家首批应用统计专业硕士培养单位，上海财经大学统计与管理学院于2011年开始招收应用统计专业硕士，主要的专业研究方向是数量金融与风险管理，2013、2014年毕业的该专业硕士生中，均有60%以上在金融行业就业。这一数据表明金融行业对于高级统计专业人才的需求十分旺盛。

在后金融危机时代，企业风险、市场风险、系统风险的控制受到格外的重视，在“新的巴塞尔协议”中已经明确提出：金融的研究要由过去的定性分析转为定量分析，充分运用金融模型来客观的评估风险。而统计学是实现风险度量、控制与管理的必要工具。在金融投资领域，如何设计新金融产品，需要借助统计学的理论与方法，金融投资与风险管理需要较多的具有良好数学基础和统计基础的较高素质的统计学人才。

为适应社会经济建设的巨大需求，自2013年起，上海财经大学统计与管理学院设置应用统计硕士（金融投资与风险管理方向）专业学位研究生教育项目，培养对象为具有国民教育系列的大学本科学历（一般应具有学士学位）的在职工作人员或往届生，无工作年限要求。学制2.5年，采用周末授课方式。研究生在修满学分、满足实习要求及完成论文答辩后，可获得国家教育部授予的“双证”——上海财经大学应用统计专业硕士研究生毕业证书与上海财经大学应用统计硕士学位证书。

## 培养目标

本项目将积极优化全日制应用统计硕士专业学位的人才培养模式，针对在职学生的特点，从教学大纲、课程设置、实践教学环节和毕业论文写作等各方面进行系统性改革。本项目师资中有金融统计方面的权威和专家：学院金融统计与风险管理学科带头人长江特聘教授、国家杰出青年周勇教授以及国务院津贴获得者中国金融学会金融统计研究专业委员会副会长、上海证交所指数委员会委员徐国祥教授等。本项目还将引进社会业界精英，共同参与

实用型人才的培养，目前，学院已构建了一支既有理论功底又有丰富实践经验的业界兼职导师队伍，其中包括中组部“千人计划”获得者，企业经理、总经理、总监等，具有博士学位的人数占一半以上。本项目将立足于学院优秀的师资，结合企业精英的参与，培养出既有坚实的数理基础，掌握丰富的统计方法，又有较强的计算机程序编制能力和数据分析能力，同时具有经济学、金融及其他相关的交叉学科专业知识、实际动手能力强的高级复合型人才。

## 培养方式

采用周末授课方式，学制为 2.5 年。如在规定时期完成课程学习，但未完成学位论文者，可按上海财经大学研究生院有关规定申请延长学习年限。

学费总计人民币 8 万元，可分两期缴付。如未能按期完成学业，需要延长学习年限的，学费标准按政府教育主管部门和学校有关规定执行。

## 报考指南

### 招生对象

有志于从事金融行业中数量分析工作的人员，对其本科背景没有任何要求。

### 报名资格

具有大学本科学历（一般应具有学士学位）的在职工作人员或往届生，无工作年限要求。

### 考试方式

考试分为初试与复试。

考生须参加初试和复试。初试由国家统一组织，方式为笔试。初试科目共有四门，总计满分为 500 分，具体包括：思想政治理论(100 分)、英语二（100 分）、经济类联考综合能力（150 分）和统计学（150 分）。其中，思想政治理论和英语二两个考试科目，由全国统一命题，考试大纲由教育部考试中心统一制订，详见“中国研究生招生信息网”

（<http://yz.chsi.com.cn>）；经济类联考综合能力科目试题委托中国人民大学命题，考试大纲见附件 1；统计学科目由上海财经大学自命题，考试大纲由《全国应用统计专业硕士教育指导委员会》制定，见附件 2。

复试由上海财经大学统计与管理学院组织，方式为面试，内容包括专业知识、外语、综合能力等。

## 报名流程

分网上报名和现场确认两个阶段，具体报名考试时间、准考证打印等相关信息详见中国研究生招生信息网（<http://yz.chsi.com.cn>）和上海财经大学研究生院网站（<http://gs.shufe.edu.cn>）。

## 录取方式

根据“德、智、体全面衡量，择优录取，宁缺毋滥，保证质量”的原则，综合考察考生的整体素质进行录取，录取名单须经学校审议，上海市高等教育招生办公室审核，国家教育部批准。2015年的招生名额为30名。

对弄虚作假者，不论何时，一经查实，即按有关规定取消报考资格、录取资格、入学资格或学籍。

## 联系方式

上海财经大学统计与管理学院

联系人：周小萍老师

电话：86 21 65901055

传真：86 21 65901099

上海财经大学研究生招生办公室

地址：上海市国定路777号育衡楼A207室

电话：86 21 65903795/65903941

传真：86 21 65904319

## 考试大纲

见附件。

### 附件1：经济类专业学位联考综合能力测试考试大纲

#### I. 考查目标

经济类联考综合能力是为了招收金融硕士、应用统计硕士、税务硕士、国际商务硕士、保险硕士及资产评估硕士而设置的具有选拔性质的联考科目。其目的是科学、公平、有效地测试考生是否具备攻读上述专业学位所必需的基本素质、一般能力和培养潜能。要求考生：

1. 具有运用数学基础知识、基本方法分析和解决问题的能力。
2. 具有较强的逻辑分析和推理论证能力。
3. 具有较强的文字材料理解能力和书面表达能力。

## II. 考试形式和试卷结构

### 一、 试卷满分及考试时间

试卷满分为 150 分，考试时间为 180 分钟。

### 二、 答题方式

答题方式为闭卷、笔试。不允许使用计算器。

### 三、 试卷包含内容

- 1、 数学基础（70 分）
- 2、 逻辑推理（40 分）
- 3、 写作（40 分）

## III. 考查内容

### 一、 数学基础

经济类联考综合能力考试中的数学基础部分主要考查考生经济分析中常用数学知识的基本方法和基本概念。

试题涉及的数学知识有：

#### 1、微积分部分

一元函数的微分、积分；多元函数的一阶偏导数；函数的单调性和值。

#### 2、概率论部分

分布和分布函数的概念；常见分布；期望值和差。

#### 3、线性代数部分

线性方程组；向量的线性相关和线性无关；矩阵的基本运算。

### 二、 逻辑推理

综合能力考试中的逻辑推理部分主要考查考生对各种信息的理解、分析、综合和判断，并进行相应的推理、论证、比较、评价等逻辑思维能力。试题内容涉及自然、社会的各个领域，但不考查有关领域的专业知识，也不考查逻辑学的专业知识。

### 三、 写作

综合能力考试中的写作部分主要考查考生的分析论证能力和文字表达能力，通过论证有效性分析和论说文两种形式来测试。

## 1. 论证有效性分析

论证有效性分析试题的题干为一段有缺陷的论证，要求考生分析其中存在缺陷与漏洞，选择若干要点，围绕论证中的缺陷或漏洞，分析和评述论证的有效性。

论证有效性分析的一般要点是：概念特别是核心概念的界定和使用是否准确并前后一致，有无明显的逻辑错误，论证的论据是否支持结论，论据成立的条件是否充分等。

文章根据分析评论的内容、论证程度、文章结构及语言表达给分。要求内容合理、论证有力、结构严谨、条理清楚、语言流畅。

## 2. 论说文

论说文的考试形式有两种：命题作文、基于文字材料的自由命题作文。每次考试为其中一种形式。要求考生在准确、全面地理解题意的基础上，对题目所给观点或命题进行分析，表明自己的态度、观点并加以论证。文章要求思想健康、观点明确、材料充实、结构严谨完整、条理清楚、语言流畅。

# 附件 2：统计学考试大纲

## I 考查目标

全国硕士研究生入学统一考试应用统计硕士专业学位《统计学》考试是为高等院校和科研院所招收应用统计硕士生而设置的具有选拔性质的考试科目。其目的是科学、公平、有效地测试考生是否具备攻读应用统计专业硕士所必须的基本素质、一般能力和培养潜能，以利用选拔具有发展潜力的优秀人才入学，为国家的经济建设培养具有良好职业道德、法制观念和国际视野、具有较强分析与解决实际问题能力的高层次、应用型、复合型的统计专业人才。考试要求是测试考生掌握数据收集、处理和分析的一些基本统计方法。

具体来说。要求考生：

1. 掌握数据收集和处理的的基本方法。
2. 掌握数据分析的基本原理和方法。
3. 掌握了基本的概率论知识。
4. 具有运用统计方法分析数据和解释数据的基本能力。

## II 考试形式和试卷结构

### 一、试卷满分及考试时间

试卷满分为 150 分，考试时间 180 分钟。

### 二、答题方式

答题方式为闭卷、笔试。允许使用计算器（仅仅具备四则运算和开方运算功能的计算器），但不得使用带有公式和文本存储功能的计算器。

### 三、试卷内容与题型结构

统计学	120 分，有以下三种题型：
单项选择题	25 题，每小题 2 分，共 50 分
简答题	3 题，每小题 10 分，共 30 分



计算与分析题	2 题, 每小题 20 分, 共 40 分
概率论	30 分, 有以下三种题型:
单项选择题	5 题, 每小题 2 分, 共 10 分
简答题	1 题, 每小题 10 分, 共 10 分
计算与分析题	1 题, 每小题 10 分, 共 10 分

### III 考查内容

#### 一、 统计学

1. 调查的组织和实施。
2. 概率抽样与非概率抽样。
3. 数据的预处理。
4. 用图表展示定性数据。
5. 用图表展示定量数据。
6. 用统计量描述数据的水平: 平均数、中位数、分位数和众数。
7. 用统计量描述数据的差异: 极差、标准差、样本方差。
8. 参数估计的基本原理。
9. 一个总体和两个总体参数的区间估计。
10. 样本量的确定。
11. 假设检验的基本原理。
12. 一个总体和两个总体参数的检验。
13. 方差分析的基本原理。
14. 单因子和双因子方差分析的实现和结果解释。
15. 变量间的关系; 相关关系和函数关系的差别。
16. 一元线性回归的估计和检验。
17. 用残差检验模型的假定。
18. 多元线性回归模型。
19. 多元线性回归的拟合优度和显著性检验。
20. 多重共线性现象。
21. 时间序列的组成要素。
22. 时间序列的预测方法。

#### 二、 概率论

1. 事件及关系和运算;
2. 事件的概率;
3. 条件概率和全概率公式;
4. 随机变量的定义;
5. 离散型随机变量的分布列和分布函数; 离散型均匀分布、二项分布和泊松分布;
6. 连续型随机变量的概率密度函数和分布函数; 均匀分布、正态分布和指数分布;
7. 随机变量的期望与方差;
8. 随机变量函数的期望与方差。