



您的位置：首页 - 所内动态

李扬参加金融工程学术年会(9月19日)

文章作者：

近日，由中国金融学会金融工程专业委员会和中国数量经济学会金融工程研究部共同主办的金融工程2003年学术年会在北京举行。中国金融学会名誉会长黄达、中国数量经济学会名誉理事长乌家培、中国金融学会副会长赵海宽、中国人民银行研究局局长兼中国金融学会秘书长谢平、中国社会科学院数量经济与技术经济研究所所长兼中国数量经济学会理事长汪同三、中国社会科学院金融研究所所长李扬、中央财经大学校长王广谦等金融工程专业委员会顾问出席会议并分别在大会上发言。来自全国各著名高等院校、研究机构、商业银行及证券机构从事金融工程教学、科研及应用的专家、学者100余人出席大会。清华大学宋逢明教授当选为中国金融学会金融工程专业委员会主任委员，并作了题为“金融工程及其在中国的发展”主题报告，介绍金融工程的发展历史、定义、核心技术及其在国内实务界和学术界的发展，展望了金融工程广阔的发展前景。

在本次学术年会上，与会专家、学者就“中国金融工程学科建设”、“中国金融工程应用”、“金融工程和IT应用”三大主题进行了研讨。

在中国已经加入世界贸易组织，迫切需要高素质的金融工程专业人才的背景下，作为人才培养的主力军的高等院校应该如何进行金融工程学科建设和人才的培养？这是各大高校普遍关心的问题。来自上海财经大学、上海交通大学、武汉大学、厦门大学、同济大学、吉林大学等十几所国内著名高校的金融院系负责人参加了“如何推动国内的金融工程学科建设和加快培养金融工程专业人才”的专题讨论。代表们一致同意，金融工程不应该脱离经济学，特别是金融经济学这一理论基础，只有打下了坚实的理论基础，一些工程技术手段才能正确应用。因此，金融工程学科的建设应该以金融经济学为基础，以工程方法、信息技术为支持手段，为资本市场、金融中介和公司财务的发展提供创新服务。与会代表对金融工程这一新兴学科体系的讨论异常热烈，一致认为深入讨论这一体系有助于解决目前金融工程专业挂靠学科混乱、专业特征不鲜明的现状。针对金融工程专业人才需求远远大于供给的现状，代表们建议应考虑长线培养和短线培训相结合的人力资源开发战略。

在“中国金融工程应用”的分会场，来自金融工程学界、业界的人士就如何利用金融工程技术改善商业银行资产质量和加强风险管理、如何利用金融工程技术推动资本市场的规范发展、金融工程对于社会保障体系和商业保险业发展如何发挥作用以及金融工程如何支持国内的金融创新等问题展开了热烈讨论。讨论中涉及了很多金融工程本土化的具体问题和金融创新的案例，比如两家外资银行推出了类似期权的产品，用变通的方法满足了市场需求，目前很多银行、基金已经开始对金融创新产品进行改良等等。

“金融工程和IT应用”的专题讨论显示了业界对加强金融工程与金融信息技术结合的强烈需求，也暴露了目前国内金融工程与IT的结合中的一些问题和困难。最突出的问题是相互学习的问题。国内目前的状况是：金融从业者不懂IT原理，IT从业者也不懂金融，这就急需一个相互学习、相互交流的过程。为了能让IT对推动金融工程在实际中的应用起到更大的作用，IT从业者希望通过细化金融工程研究课题，再把它们实际化，转变成实际的工程项目，这样就能更清楚地去了解产品的最终用户，即金融从业者究竟需要他们做什么。其中，来自IT行业的代表和其他与会者分享了他们在为基金设计具体产品过程中的心得：金融市场区别于其他市场的重要特殊性之一是一项产品的推出很可能会带来很大的外部社会效应，这就要求在进行产品设计时应考虑到该新产品对整个金融市场和系统稳定性的影响。由于目前在实际设计产品的过程中，金融部门和IT部门的相互支持和了解有限，所设计出来的产品存在行业内差别小、同一化特征明显的现象。严重的产品同一化现象往往会增加整个金融系统的不稳定因素，而具有核心竞争力、差异性较大的产品设计，以我国目前的水平还达不到，急需金融工程方法论在相关交叉领域中的传播和学习。此外，与会者还就IT在金融工程中所起的作用和扮演的角色展开了热烈的讨论。一个有趣的比喻是如果把金融工程产品的推出比喻成做菜，那么金融工程师才是真正掌厨的一个，而IT从业者的工作就是如何利用他们的专业知识为厨师订做出一套像精良的厨具这样的硬件系统，帮助金融工程师做好这一道“菜”。

自20世纪90年代中期金融工程被引进、介绍到中国以来，在短短的几年时间内这一新兴专业获得了蓬勃迅速的发展，今年，已经有10所大学招收“金融工程”专业的本科生。然而，同任何新兴的交叉学科一样，金融工程专业目前也存在着学科体系混乱、人才培养不规范等问题。与会代表的共识是，金融工程的前景是广阔的，但是需要各界人士不断努力，才能真正推动金融工程学科体系的建设和专业人才的培养，使金融工程这一具有强大生命力的新兴学科深深植根于中国的土壤并茁壮地成长。

[\[推荐朋友\]](#) [\[关闭窗口\]](#) [\[回到顶部\]](#)

转载务经授权并请刊出本网站名

中国博士论坛

中国社会科学院
保险与经济研究中心

IFB外商投资中心

IFB基金研究
与评价中心



地址：北京市东城区建国门内大街5号 邮编：100732 电话：010-65136039 传真：010-65138307
版权所有：中国社会科学院金融研究所