

# 复旦大学金融学单独考试硕士研究生招生考试

## 932 经济学综合基础（单）考试大纲

### 一、政治经济学

#### （一）导论

1、“生产、分配、交换、消费”之间的关系，及其对我国社会经济发展的指导意义

2、生产力与生产关系及其相互关系

3、经济基础和上层建筑的辩证关系

4、政治经济学的研究对象和范围

5、经济规律

6、政治经济学的研究方法

#### （二）商品与货币

1、具体劳动和抽象劳动

2、劳动二重性与商品二因素及其关系

3、劳动生产率和商品价值量的关系

4、私人劳动和社会劳动的矛盾是简单商品生产的基本矛盾

5、价值形式的发展和货币的起源、货币的本质和职能、货币流通规律

6、价值规律的内容、价值规律作用的表现形式以及价值规律的作用

7、深化对马克思劳动价值理论的认识(局部劳动和总体劳动，创造价值的劳动，价值创造与财富生产的关系)

#### （三）资本与剩余价值

1、资本总公式的矛盾及其解决

2、劳动力商品的价值与使用价值

3、剩余价值的生产

4、资本的本质、不变资本与可变资本、把资本划分为不变资本和可变资本的依据和意义

5、绝对剩余价值、相对剩余价值、超额剩余价值以及三者的相互关系

6、现代生产自动化条件下剩余价值的源泉，工资的本质，当代劳资关系

#### （四）资本积累与再生产

1、从商品生产所有权规律转变为资本主义占有规律理解资本积累的实质

2、资本价值构成和技术构成的关系、资本有机构成、资本有机构成不断提高的原因

3、资本积聚与资本集中、相对过剩人口的产生

4、资本主义制度下的相对过剩人口与社会主义市场经济发展过程中出现的失业现象

#### （五）资本循环与周转

1、产业资本三种循环形态的片面性、产业资本正常循环的基本条件

2、固定资本和流动资本、把资本划分为固定资本和流动资本的依据和意义

3、生产资本两种划分的区别

4、固定资本磨损及其成因，影响资本周转速度的因素，加速资本周转的意义和途径

#### （六）社会总资本在生产与经济危机

1、研究社会总资本运动的出发点和核心问题

2、社会总资本简单再生产的实现条件及其经济含义

3、社会资本扩大再生产的前提条件，社会总资本扩大再生产的实现条件及其经济含义

4、经济危机的实质与根源，固定资本更新是资本主义经济危机周期性存在的物质条件

#### （七）剩余价值的分配

1、平均利润的形成过程、平均利润的决定因素，平均利润下降规律

2、商业利润的来源及其获得途径

3、股份资本和股票价格

4、虚拟资本及其与实际资本的关系、虚拟资本的作用

5、地租的本质，级差地租产生的条件与原因、绝对地租产生的条件和原因，土地价格及其变动趋势

#### （八）垄断资本主义的发展演变与经济全球化

1、垄断的形成、垄断与竞争的关系、垄断条件下竞争存在的原因，垄断价格

2、国家垄断资本主义产生发展的过程、原因与性质

3、经济全球化性质的二重性

(九) 社会主义初级阶段的基本经济制度

1、坚持公有制经济的主体地位，鼓励、支持和引导非公有制经济的发展

2、非公有制经济发展“不禁止则自由”的思想

3、国有资本和民间资本，中小民营企业生存困境及其解决

(十) 社会主义市场经济体制

1、计划和市场两种资源配置方式的 DIM 结构，经济制度与经济体制

2、社会主义市场经济体制的特征，政府与市场的关系

3、社会主义市场经济运行中的经济机制(价格机制、供求机制、竞争机制、风险机制)及其特征

4、社会主义市场规则，健全和完善社会主义现代市场体系

(十一) 社会主义市场经济的微观基础

1、微观基础的基本特征、市场经济微观基础的形成条件：明确的产权界定

2、中国国有企业改革的历程和内在逻辑，现代企业制度的基本特征、公司的法人治理结构

3、中国农户经营的利弊，农村土地产权制度改革与农户经营的关系

4、社会主义市场经济中农户的经济行为

(十二) 收入分配与社会保障

1、政府进行再分配的原因以及再分配的功能，按劳分配与生产要素按贡献分配的基本含义和要求

2、当前我国收入分配差距、分配制度改革和分配关系的调整，当前我国分配制度的改革重点和政策取向

3、收入分配中的效率与公平，以初次分配促进公平和效率的统一

4、建立健全多层次社会保障制度

5、消费与生产的辩证关系，消费对经济的拉动作用

(十三) 社会主义市场经济中的对外经济关系

1、我国对外开放的发展战略、优化开放结构

2、一带一路战略

#### (十四) 宏观经济运行与调控

1、通货膨胀及其影响，通货紧缩及其影响

2、转型经济中的就业问题

3、宏观调控的目标及其关系

4、宏观调控政策及其运用，宏观政策选择

#### (十五) 经济增长和经济发展

1、经济增长的影响因素及其作用机理

2、经济增长方式转变中制度因素的重要性，经济增长方式转变与体制转变的关系

3、经济发展方式转变的内涵、经济增长方式转变与经济发展方式转变的联系和区别

4、我国经济发展方式转变的实现机制

5、可持续发展的含义及其特征，全面建成小康社会的目标

## 二、微观经济学、宏观经济学

### (一) 需求、供给与市场均衡

1、需求与需求函数，需求定律，需求量的变化与需求的变化

2、供给与供给函数，供给量的变化与供给的变化

3、弹性的定义，点弹性，弧弹性，弹性的几何表示

4、需求价格弹性、需求收入弹性、需求交叉弹性

5、市场均衡的形成与调整，市场机制的作用

6、需求价格弹性与收益、蛛网模型

### (二) 消费者行为理论

1、效用的含义，基数效用论和序数效用论，效用的基本假定

2、总效用与边际效用，边际效用递减规律

3、无差异曲线、预算线与消费者均衡

4、替代效应与收入效应，希克斯方法与斯卢斯基方法，吉芬商品

### (三) 生产理论

- 1、生产函数，短期与长期，边际报酬递减法则
- 2、总产品、平均产品与边际产品，生产的三阶段论
- 3、等产量线、等成本线与生产者均衡，生产的经济区
- 4、柯布一道格拉斯生产函数、CES 生产函数

#### （四）成本理论

- 1、会计成本与经济成本，会计利润与经济利润
- 2、短期成本函数与短期成本曲线族
- 3、长期成本函数与长期成本曲线，规模经济与规模不经济，规模报酬的测度与变化规律
- 4、长期成本曲线与短期成本曲线的关系，成本曲线与生产函数的关系

#### （五）完全竞争市场

- 1、完全竞争市场的特征
- 2、完全竞争市场的短期均衡与长期均衡
- 3、完全竞争市场与帕累托最优
- 4、消费者剩余，生产者剩余和管制的福利分析

#### （六）完全垄断市场

- 1、完全垄断市场的特征，垄断的成因
- 2、完全垄断厂商所面临的需求曲线与平均收入线、边际收入线
- 3、完全垄断市场的均衡
- 4、完全垄断市场的评价
- 5、垄断者的定价策略，包括价格分歧、两步收费和搭售
- 6、反垄断的原理与争议

#### （七）垄断竞争市场

- 1、垄断竞争市场的特征
- 2、主观需求曲线与实际需求曲线
- 3、垄断竞争市场的短期均衡与长期均衡
- 4、最优广告投放分析

#### （八）寡头垄断市场

- 1、寡头垄断市场的特征

2、古诺模型

3、折弯的需求曲线

4、价格领导，卡特尔

（九）博弈论及其应用

1、博弈论的基本概念

2、完全信息静态博弈下的纳什均衡

3、动态博弈

4、不完全信息博弈

5、博弈论的基本概念及其应用

（十）信息不对称与机制设计

1、信息不对称的概念、机制设计的原理

2、逆向选择问题、信号发送与信息甄别

3、道德风险问题及其解决

4、机制设计的应用

（十一）宏观经济指标

1、国民收入核算

2、GDP

3、失业率

4、通货膨胀率

（十二）简单凯恩斯模型

1、消费函数、储蓄函数、投资函数

2、均衡国民收入的决定

（十三）IS-LM 模型

1、货币需求函数

2、IS 曲线

3、LM 曲线

4、IS-LM 模型的均衡及其变动

（十四）AD-AS 模型

1、AD 曲线

2、AS 曲线

3、AD-AS 模型的均衡及其变动

（十五）失业与通货膨胀

1、失业的类型及原因

2、通货膨胀的原因及影响

3、失业与通货膨胀的关系

（十六）开放经济下的宏观经济模型

1、汇率变动的的原因及其影响

2、国际收支平衡表

3、蒙代尔-弗莱明模型及其政策含义

（十七）经济增长理论

1、索洛经济增长模型

2、哈罗德经济增长模型

（十八）宏观经济政策

1、宏观经济政策的目标

2、财政政策

3、货币政策

4、政策效果评价

### **三、国际金融学**

（一）国际收支与国际收支平衡表

1、国际收支及国际收支平衡表

2、国际收支失衡及其调节

（二）外汇与汇率

1、国际金融市场

2、汇率与汇率制度

（三）汇率理论

1、汇率水平决定理论

2、汇率制度选择理论

（四）国际收支内外部均衡

1、内外部均衡的冲突

- 2、内外部均衡冲突的调节原则
- 3、内外部均衡调节的经典理论
- 4、开放经济下的政策搭配理论

#### （五）外汇管理

- 1、外汇直接管制
- 2、汇率制度选择
- 3、外汇储备管理
- 4、外汇市场干预

#### （六）国际资本流动与金融危机

- 1、国际资本流动
- 2、债务危机、银行危机、货币危机以及次贷危机

#### （七）国际金融协调与合作

- 1、国际货币协调的理论
- 2、国际货币协调的主要问题及制度安排
- 3、区域货币协调的理论与实践

### 四、投资学

#### （一）金融市场与机构

- 1、资产市场类别与金融工具
- 2、证券交易和监管机制
- 3、金融机构

#### （二）投资组合理论

- 1、风险与收益的度量
- 2、风险偏好
- 3、均值方差分析
- 4、资产组合选择与管理
- 5、投资组合业绩评价

#### （三）均衡资本市场理论

- 1、资本资产定价模型
- 2、无套利定价理论及因素模型
- 3、有效市场假说及行为金融理论

4、证券收益的实证分析（包括：CAPM，APT，Fama-French 多因子模型）

（四）普通股价值分析

- 1、收入资本化法与普通股价值分析
- 2、股息贴现模型
- 3、市盈率模型
- 4、股票投资的配置策略

（五）固定收益证券

- 1、债券的价格与收益
- 2、利率的期限结构
- 3、利率风险管理
- 4、信用风险和信用衍生产品

（六）远期、期货、期权与其它衍生证券

- 1、远期
- 2、期货
- 3、互换
- 4、期权定价理论和运用

**五、公司金融**

（一）财务报表分析

- 1、会计报表
- 2、财务比率分析

（二）资本预算

- 1、现金流与折现
- 2、投资决策方法比较
- 3、自由现金流
- 4、项目净现值
- 5、项目系统性风险
- 6、实物期权

（三）资本成本

- 1、普通股成本
- 2、债务成本

### 3、加权平均资本成本（WACC）

#### （四）资本结构

- 1、税、破产和资本结构
- 2、管理者动机、信息不对称和资本结构
- 3、目标资本结构

#### （五）股利政策

- 1、股利政策理论
- 2、股利政策实践

#### （六）营运资本管理

- 1、营运资本政策
- 2、现金和有价值证券管理
- 3、应收账款管理
- 4、短期融资的方式、原则和策略

#### （七）收购与兼并

- 1、公司估值
- 2、并购动因及效应
- 3、杠杆收购
- 4、并购理论

#### （八）公司治理

- 1、代理问题
- 2、剥夺问题
- 3、公司治理机制