

2021 年硕士研究生入学考试大纲

考试科目名称：金融学综合

考试科目代码：431

一、 考试要求

金融学综合的考试大纲适用于北京工业大学经济与管理学院(0251)金融(专业学位)的硕士研究生招生考试。考试内容包含金融学和证券投资学两个部分,这两门课程是金融学科最为重要的基础理论课。金融学的考试内容主要包括货币与金融、金融中介与金融市场、货币均衡与宏观政策与金融发展与稳定四个部分;证券投资学的考试内容主要包括基本知识、投资分析、技术分析、证券组合投资四个部分。

要求考生对其中的基础知识、基本概念和理论构架有很深入的理解,掌握理论分析和数理模型分析的方法和技巧,具有综合运用所学知识对社会发展过程中典型的宏观经济、金融现象进行分析、预测和解释的能力。

二、 考试内容

(一) 金融学部分

1. 货币与金融

深入理解货币、货币范畴与货币职责、信用与信用形式、货币制度与演变、金融范畴的形成与发展;外汇与汇率、国际货币体系与汇率制度;利息、利率中涉及的概念;熟练掌握汇率变动、利率决定的影响因素及机理。

2. 金融中介与金融市场

熟练掌握金融中介体系、金融市场、存款货币银行、中央银行各自的范畴、业务特征、经营原理、职责与格局;深入理解金融体系结构与金融制度的形成原因。

3. 货币均衡与宏观政策

深入理解存款货币创造机制;不同的货币需求理论及理论发展脉络;货币供给影响因素;货币均衡与开放经济下的均衡;通货膨胀与通货紧缩的概念、形成机制与影响机理;货币政策目标、工具、传导机制及影响,并能够对现实中货币政策进行分析。

4.金融发展与稳定

熟练掌握货币经济与实际经济、金融发展与经济增长、金融稳定与金融危机及金融监管对金融体系、宏观经济的制约及影响。

(二) 证券投资学部分

1.基本知识

理解债券的基本要素、分类和特征；熟练掌握债券的收益率计算；理解股票的特征和分类、证券投资基金的分类和区别，实物资产和金融资产的含义和区别，金融资产的分类；理解证券市场的分类和功能，证券市场的微观主体内容和证券交易场所的类别、证券交易所的成员组成，熟练掌握股票价格指数的计算方法。

2.投资分析

理解经济周期波动对证券市场的影响，宏观经济政策与证券市场的关系；理解产业生命周期分析，产业竞争结构分析；理解公司财务分析中的偿债能力比率、营运能力比率、盈利能力比率指标；熟练掌握杜邦分析法；理解股利贴现法和自由现金流贴现法两个模型的内容、特点和应用；理解相对估值法的内容、特点和应用。

3.证券投资技术分析

理解技术分析的道氏理论、K线理论的基本内容；熟练掌握K线的基本形状和含义；深入理解和掌握K线的典型组合形态；理解支撑线和压力线、趋势线和轨道线、黄金分割线和百分比线的含义和应用，形态理论中的价格曲线的类型、形态和应用；理解波浪理论的价格基本形态。

4.证券组合投资

理解证券风险的类别和组合投资的基本类型；理解资本资产定价模型、套利定价模型和期权定价模型的基本内涵。

三、参考书目

- 1.黄达、张杰著.《金融学》，第四版，中国人民大学出版社，2017.04
- 2.吴晓求著.《证券投资学》，第四版，中国人民大学出版社，2014.02