

# 2019 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金融硕士专业学位的研究生招生考试。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

### 金融学部分：

#### （一）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。

#### （二）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。

#### （三）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。

#### （四）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。

### 证券投资学部分

#### （一）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。

#### （二）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。

#### （三）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。

#### （四）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