**金融专业综合考试大纲**

【考查目标】

1．了解投资的基本原理、方法、类型、投资与经济发展的关系、投资体制、投资结构，必要的风险控制方法；理解证券、证券市场、与证券定价原理、产业投资的市场分析、供给因素分析；掌握证券投资的组合管、产业投资的效益分析、投资结构周期规律

2．了解有关国际收支、汇率、国际资本流动及金融危机的经典理论，理解国际货币体系和国际金融组织的沿革和现状，理解外汇市场交易、外汇风险管理和国际融资的基本原理和方法，掌握有关国际储备、国际金融市场、汇率制度的研究动态和重要结论。

3．具备应用金融专业理论与方法分析、解决问题的能力。

【参考书目】

1、滋维·博迪等著，《投资学》（原书第10版），机械工业出版社，2015年。

2、姜波克编著，《国际金融新编》（第六版），复旦大学出版社，2018年。

【考试内容】

**一、投资学**

（一）金融工具与金融市场

1、货币市场

2、债券市场

3、权益市场

4、股票市场指数

5、衍生工具市场

6、投资基金

（二）资产组合理论

1、风险与收益基本知识

2、风险厌恶与风险资产配置

3、分散化与组合风险

4、最优风险资产组合

5、马科维茨资产组合理论

6、指数模型

（三） 资本市场均衡

1、资本资产定价模型

2、套利定价理论与风险收益多因素模型

3、有效市场假说；

（四）固定收益证券

1、债券的价格与收益

2、利率的期限结构

3、债券资产组合管理

（五）证券投资分析

1、宏观经济分析与行业分析

2、权益估值模型

3、财务报表分析

（六） 期权、期货与其他衍生证券

1、期权市场

2、期权价格性质

3、期货市场

4、期货定价基本原理

**二、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