|  |
| --- |
| **《证券投资学》考试大纲****适用专业名称：金融硕士** |
| **科目代码及名称** | **考试大纲**  |
| **证券投资学** | 1. **考试目的与要求**

测试考生对证券市场的基础知识和基本理论，证券市场的架构和交易工具、运作机制和运行规律，证券投资的收益、风险之间的关系和有价证券的定价原理、以及证券投资的分析方法和管理方法的理解掌握程度，对知识的运用能力；要求考生准确记忆基本概念，理解基本理论，并能妥善运用到综合题目的分析中，具有较强的分析和解决证券投资实际问题的能力；要求考生对最新的证券投资动态有一定了解。1. **试卷结构**（满分100分）

内容比例： 证券投资要素 约10分证券市场的运行和管理 约20分证券交易 约10分证券投资的收益和风险 约20分证券投资对象分析 约10分证券投资的基本分析 约10分证券投资的技术分析 约10分 现代证券投资理论 约10分题型比例： 客观题 约40分  1．简答题 约20分  2．名词解释题 约20分 主观题 约60分 　 1．论述题 约60分**三、考试内容与要求****（一）证券投资概述**考试内容 证券投资要素。考试要求  1. 掌握投资主体和客体。 2. 理解证券中介机构。**（二）证券市场**考试内容证券市场的运行和管理考试要求1. 掌握证券发行市场：证券发行市场的结构特点、股票发行市场、债券发行市场。2. 熟悉证券流通市场：证券交易所、场外交易市场、第二板市场。3. 掌握证券市场监管的主要内容。4. 综合运用以上内容进行合理地分析和论述。**（三）证券交易**考试内容证券交易程序和方式。考试要求1. 理解证券交易程序。2. 掌握证券交易委托方式：市价委托指令、限价委托指令、停止损失委托指令、停止损失限价委托指令。3. 理解证券交易方式。4. 综合运用以上内容进行合理地分析和论述。**（四）证券投资收益与风险**考试内容证券投资的收益和风险。考试要求1. 理解证券投资的收益。2. 掌握证券投资的风险：系统风险、非系统风险、收益和风险的关系。3. 掌握证券风险的衡量：单一证券风险的衡量、证券组合风险的衡量、系统风险的衡量。4. 综合运用以上内容进行合理地分析和论述。**（五）证券投资对象分析**考试内容证券投资对象分析。考试要求1. 掌握债券分析。2. 掌握股票分析：股票的理论价格、影响股票价格的因素、股票价格指数。3. 其他投资工具分析：优先认股权、认股权证、可转换证券。4. 综合运用以上内容进行合理地分析和论述。**（六）证券投资的基本分析**考试内容证券投资的基本分析。考试要求1. 掌握经济分析：信息的内容及来源、宏观经济分析、行业分析、公司分析。2. 理解财务分析：企业主要的财务报表、财务报表的分析方法、财务比率分析。3. 综合运用以上内容进行合理地分析和论述。**（七）证券投资的技术分析**考试内容证券投资的技术分析。考试要求1. 理解证券投资技术分析理论。2. 掌握证券投资技术分析实务。 3. 综合运用以上内容进行合理地分析和论述。**（八）现代证券投资理论**考试内容现代证券投资理论。考试要求1. 现代证券投资理论的产生与发展、证券组合理论。2. 掌握资本资产定价模型。3. 掌握资本资产套价理论。4. 综合运用以上内容进行合理地分析和论述。**参考书目**： 《证券投资学》，霍文文主编，高等教育出版社，2017年 |