|  |  |
| --- | --- |
| **《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 |