**2024年宁波大学硕士研究生招生考试复试科目**

**考　试　大　纲**

|  |  |
| --- | --- |
| **科目名称:** | **金融工程** |

**一、考试形式与试卷结构**

**（一）试卷满分及考试时间**

本试卷满分为100分，考试时间为150分钟。

**（二）答题方式**

答题方式为闭卷、笔试。

**（三）试卷题型结构**

1.简答题

2.计算题

3.论述题

**二、考查目标（复习要求）**

《金融工程》研究内容主要包括远期、期货、互换等金融衍生产品，并解决金融市场中衍生产品定价和风险管理等相关问题，以及如何对资产组合、风险控制进行定量分析。主要要求考生熟悉远期、期货、期权等衍生产品，掌握交易策略，套期保值以及衍生产品定价的一般方法。

**三、考查范围或考试内容概要**

**第一章**  什么是金融工程，金融工程的基本分析与方法

**第二章**  远期与期货概述，远期与期货的比较

**第三章**  远期价格，远期合约的定价，期货价格

**第四章**  远期与期货的运用：套期保值、套利与投机

**第五章**　　股指期货、外汇远期、利率远期与利率期货

**第六章**　　互换概述

**第七章**  利率互换和货币互换的定价

**第八章**  互换的运用：运用互换进行套利、风险管理

**第九章** 　期权的定义，期权市场，期权交易机制

**第十章**　　期权的回报与盈亏分布，期权价格的特性

**第十一章**　布莱克—舒尔斯—默顿期权定价公式

**第十二章**　期权定价的数值方法：二叉树定价模型，蒙特卡诺方法和有限差分方法

**第十三章** 期权交易策略及其运用

**第十四章**　期权价格的敏感性和期权的套期保值

**第十五章**　欧式股票指数期权、外汇期权和期货期权的定价

**第十六章** 奇异期权

**第十七章** 风险管理：在险值，信用风险管理

**参考教材或主要参考书**：

《金融工程》（第四版），郑振龙、陈蓉主编，高等教育出版社，2016年。