**北京第二外国语学院攻读硕士学位研究生入学考试**

**《金融学综合》考试大纲**

**一、适用的招生专业**

金融

**二、考试的基本要求**

采用闭卷考试，满分150分。考试时间180分钟。

**三、试卷结构**

1.名词解释 （约30分）

2.判断题 （约20分）

3.计算题 (约20分)

4.简答题 （约50分）

5.论述分析题（约30分）

**四、考试的主要要求及内容**

《投资学》部分考试着重考察考生对下列理论和知识的掌握程度以及运用应用相关理论知识分析解决实际问题的能力：（1）资本市场的产品、投资者和市场运行的基础知识；（2）现代投资学的基本理论和方法；（3）期货、期权等金融衍生品的基础知识。

《公司金融学》部分着重考察考生公司理财基本原则、财务分析与公司理财、资本预算和长期财务决策。

**第一部分：投资学**

1.资本市场的运行

金融市场的产品、资本市场的参与者、发行市场和流通市场、融资融券、股票的除权和复权

2.投资风险与收益

投资风险、投资收益、风险与收益的关系

3.投资组合

投资组合的风险、投资组合的收益、投资组合的可行集与有效集、投资组合的选择

4.风险定价理论

资本资产定价模型、多因子模型、套利定价理论

5.股票的价值分析

股票的投资信息及分类、股票绝对价值评估、股票的相对价值评估

6.债券投资分析

债券估价、债券到期收益率与利率期限结构、债券久期及其运用

7.期货市场

期货及其交易机制、期货价格的确定、期货的功能、期货在投资中的运用

8.期权市场

期权合约要素及分类、美式看涨和看跌期权、欧式期权分析、期权的交易策略

**第二部分：公司金融**

1.公司理财概览

企业组织形态、财务管理目标、代理问题与公司控制、从金融角度理解财务报表、自由现金流量

2.财务报表与长期财务计划

财务报表分析、长期财务计划与增长

3.未来现金流估值

货币的时间价值、贴现现金流估值、利率与债券估价、股票估价

4.资本预算

净现值和其他投资准则、资本性投资决策、项目分析与评估

5.资本成本与长期财务政策

资本成本概念与加权资本成本的计算、筹集资本 、财务杠杆与资本结构政策、股利与股利政策

**五、参考书目**

1. 贺显南《投资学原理及应用》（第五版），机械工业出版社，2024年。

2. 罗斯《公司理财》（精要版、原书第12版），机械工业出版社，2020年。