

# 东北林业大学

## 2024 年硕士研究生招生考试自命题科目考试大纲

考试科目代码：431

考试科目名称：金融学综合

考试内容范围：

### 一、货币与货币制度

要求考生掌握货币的职能与货币制度和国际货币体系；

### 二、利息与利率

要求考生熟练利息、利率决定理论、利率的期限结构；

### 三、金融市场与机构

要求考生熟练掌握金融市场及其要素、货币市场、资本市场、衍生工具市场、金融机构（种类、功能）；

### 四、商业银行

要求考生掌握商业银行的负债业务、商业银行的资产业务、商业银行的中间业务和表外业务和商业银行的风险特征；

### 五、现代货币创造机制

要求考生熟练掌握存款货币的创造机制、中央银行职能、中央银行体制下的货币创造过程；

### 六、货币供求与均衡

要求考生熟练掌握货币需求理论、货币供给、货币均衡和通货膨胀与通货紧缩；

### 七、货币政策

要求考生熟练掌握货币政策及其目标、货币政策工具，了解货币政策的传导机制和中介指标；

### 八、证券投资与证券市场

要求考生熟练掌握证券市场主体、证券市场的类型和层次、证券市场的监管；

### 九、证券发行与交易

要求考生熟练掌握货币证券的发行与交易、债券的发行和交易、股票的发行与交易、金融衍生工具的创设与交易、证券信用交易；

### 十、有效市场假说

要求考生掌握有效市场理论；

### 十一、投资组合的选择

要求考生熟练掌握资产组合的含义与度量、有效集及无差异曲线、最佳资产组合的选择、投资分散化；

### 十二、资本资产定价模型

要求考生熟练掌握资本资产定价模型、市场模型与特征线方程、单个证券与组合的风险；

### 十三、因素模型与套利定价理论

要求考生掌握因素模型、套利定价；

#### 十四、债券定价分析

要求考生熟练掌握影响债券定价的因素、债券定价、债券的评级、债券收益与风险分析、可转换公司债券的价格；

#### 十五、债券组合管理

要求考生熟练掌握利率期限结构、久期、消极的债券组合管理、积极的债券组合管理策略。

#### 参考书目：

1. 上海财经大学金融学院. 投资学教程(第三版). 上海财经大学出版社, 2023 年

2. 黄达. 金融学(第四版), 中国人民大学出版社, 2017 年

考试总分：150 分      考试时间：3 小时      考试方式：笔试