硕士研究生入学考试大纲

考试科目名称：金融市场学

**一、考试大纲援引教材**

《金融市场学》 清华大学出版社 张薇薇 2017年7月

**二、考试要求：**

要求学生全面系统地掌握货币市场、资本市场、外汇市场和衍生金融市场，掌握投资组合理论和资本资产定价理论。

**三、考试内容：**

**1. 货币市场**

* 同业拆借市场
* 回购市场
* 商业票据市场
* 银行承兑汇票市场
* 短期政府债券市场
* 货币市场基金

**2. 资本市场**

* 股票市场
* 债券市场
* 投资基金市场

**3. 外汇市场**

* 外汇市场概述
* 外汇市场的构成
* 外汇市场的汇率决定理论
* 外汇市场的交易方式

**4. 衍生金融交易**

* 远期交易
* 期货交易
* 期权交易
* 互换交易
1. **债券价值分析**
* 债券的定价
* 债券价格的影响因素
* 债券定价原理
1. **股票价值分析**
* 股票价格的影响因素
* 股息贴现模型
* 市盈率模型
* 第四节自由现金流模型

**7.证券投资组合理论**

* 金融风险的定义和分类
* 投资收益与风险的衡量
* 证券组合与分散风险
* 风险偏好与无差异曲线
* 有效集与最优投资组合

**8. 资产定价理论**

* 资本资产定价模型
* 因素模型与套利定价理论