**大连海事大学硕士研究生入学考试大纲**

考试科目：证券投资学

一、**证券投资工具**

**考试内容**

1. 债券和股票

2. 证券投资基金

3. 金融衍生工具

4. 另类投资工具

**考试要求：**

1. 了解本课程研究的对象、内容；

2. 了解证券投资工具的分类和功能。

二、**证券市场**

**考试内容**

1. 证券市场概述

2. 证券市场的运行机制

3. 证券市场监管

**考试要求**

1.了解证券市场。

2.了解证券市场的运行与监管。

三、资产定价理论及其发展

**考试内容**

1. 资产定价理论

2. 行为金融资产定价理论

**考试要求**

1. 学习金融资产定价理论；

2. 学习行为金融资产定价理论；

四、**证券投资的宏观经济分析**

**考试内容**

1. 宏观经济分析概述

2. 宏观经济运行对证券市场的影响

3. 宏观经济政策与证券市场

4. 经济周期、经济政策对大类资产及证券市场的综合影响

**考试要求**

1. 了解宏观经济与政策特点

2. 分析宏观经济变化对证券市场的影响

五、证券投资的产业分析

**考试内容**

1. 产业的基本特征分析

2. 产业生命周期分析

3. 产业结构分析

**考试要求**

1. 了解产业的基本特征

2. 掌握产业生命周期分析方法

3. 学习和理解产业结构

六、**公司****财务分析**

**考试内容**

1. 基于资产负债表的资产管理分析

2. 基于损益表的经营效益分析

3. 基于现金流量表的现金流分析

**考试要求**

1. 了解资产负债表、损益表和现金流量表

2. 学习财务分析

七、公司价值分析

**考试内容**

1. 公司基本分析

2. 绝对估值法

3. 相对估值法

**考试要求**

1. 了解公司基本分析

2. 掌握公司价值的估值方法

**八、证券组合管理**

**考试内容**

1. 证券组合管理概述

2. 马科维茨选择资产组合的方法

**考试要求**

1. 了解证券组合管理

2. 掌握马科维茨选择资产组合的方法

**九、风险资产的定价与证券组合管理的应用**

**考试内容**

1. 资本资产定价模型

2. 套利定价理论

3. 期权定价理论

**考试要求**

1. 掌握资本资产定价模型和套利定价理论

2. 了解期权定价理论

**参阅**：

1. 滋维. 博迪（美），投资学（第10版），机械工业出版社，2017。
2. 吴晓求，证券投资学（第5版），中国人民大学出版社，2020。