**上海理工大学金融硕士（MF）专业学位**

**研究生入学统一考试《金融学综合》（431）考试大纲**

**一、考试性质**

《金融学综合》是金融硕士（MF）专业学位研究生入学统一考试的科目之一。《金融学综合》考试要力求反映金融硕士专业学位的特点，科学、公平、准确、规范地测评考生的基本素质和综合能力，选拔具有发展潜力的优秀人才入学，为国家的经济建设培养具有良好职业道德、具有较强分析与解决实际问题能力的高层次、应用型、复合型的金融专业人才。

**二、考试要求**

测试考生对于与金融学、证券投资学相关的基本概念、基础理论的掌握和运用能力。

**三、考试内容**

**第一部分　金融学**

一、货币与货币制度

●　货币的职能与货币制度

●　国际货币体系

二、利息和利率

●　利息

●　利率决定理论

●　利率的期限结构

三、外汇与汇率

●　外汇

●　汇率与汇率制度

●　币值、利率与汇率

●　汇率决定理论

四、金融市场与机构

●　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）

五、商业银行

●　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

●　商业银行的风险特征

六、现代货币创造机制

●　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

七、货币供求与均衡

●　货币需求理论

●　货币供给

●　货币均衡

●　通货膨胀与通货紧缩

八、货币政策

●　货币政策及其目标

●　货币政策工具

●　货币政策的传导机制和中介指标

九、国际收支与国际资本流动

●　国际收支

●　国际储备

●　国际资本流动

十、金融监管

●　金融监管理论

●　巴塞尔协议

●　金融机构监管

●　金融市场监管

**第二部分 证券投资学**

一、证券投资工具

* 股票的定义、类型及股票价格指数
* 债券的定义、分类、可转换公司债券
* 债券投资基金的定义、分类、设立发行与交易、管理机制、估价与收益分配、投资运作
* 金融期货与期权、可转换证券、其他金融衍生工具

二、证券市场

* 证券市场概述
* 证券市场主体
* 证券市场中介机构
* 证券市场的发展状况

三、证券市场运行与监督

* 证券发行市场的定义
* 证券发行的目的、方式、定价方式及基本程序
* 证券交易市场
* 证券市场监督

四、证券交易

* 证券交易方式
* 证券交易程序与费用
* 证券交易价格

五、证券投资的价值分析

* 债券投资价值分析
* 股票投资价值分析
* 其他证券投资价值分析

六、证券投资的基本面分析

* 证券投资的宏观经济因素分析
* 证券投资的行业因素分析
* 证券投资的公司因素分析

七、证券投资的技术面分析

* 技术分析理论
* 技术图形分析
* 技术指标分析

八、投资组合理论

* 证券投资的收益与风险
* 证券投资收益与风险的衡量；
* 投资组合最优化的标准

九、证券投资实务

* 证券投资策略
* 证券投资时机的选择
* 证券投资方法的应用

**四、考试方式与分值**

本科目满分150分，由上海理工大学自行命题，全国统一考试。