

广东金融学院 2013 年金融硕士专业学位研究生入学考试
《金融学综合》考试大纲（初试科目）

《金融学综合》是我校 2013 年金融硕士专业学位研究生入学统一考试的科目之一。考试范围包括宏观金融（含《货币银行学》与《国际金融学》的内容）和微观金融（含《公司金融》与《投资学》的内容）两大部分，主要测试考生对于金融学科的基本概念、基础理论的掌握程度和分析运用能力。

本科目满分 150 分，其中宏观金融部分分值为 90 分，微观金融部分分值为 60 分。

第一部分 宏观金融

一、货币与货币制度

- （一）货币的职能与货币制度
- （二）国际货币体系

二、利息和利率

- （一）利息
- （二）利率决定理论
- （三）利率的期限结构

三、外汇与汇率

- （一）外汇
- （二）汇率与汇率制度
- （三）汇率的影响因素及汇率的作用
- （四）汇率决定理论

四、金融市场与机构

- （一）金融市场及其要素
- （二）货币市场
- （三）资本市场
- （四）衍生工具市场
- （五）金融机构（种类、功能）

五、商业银行

- （一）商业银行的负债业务
- （二）商业银行的资产业务
- （三）商业银行的中间业务和表外业务
- （四）商业银行的风险特征

六、现代货币创造机制

- （一）存款货币的创造机制
- （二）中央银行职能
- （三）中央银行体制下的货币创造过程

七、货币供求与均衡

- （一）货币需求理论
- （二）货币供给
- （三）货币均衡
- （四）通货膨胀与通货紧缩

八、货币政策

- (一) 货币政策及其目标
- (二) 货币政策工具
- (三) 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
 - (一) 国际收支平衡与调节
 - (二) 国际资本流动与管理
 - (三) 开放经济下的宏观均衡与政策配合
- 十、金融监管
 - (一) 金融监管理论
 - (二) 巴塞尔协议
 - (三) 金融机构监管
 - (四) 金融市场监管
 - (五) 金融危机防范政策与理论

参考书:

- 1.《金融学》第二版（货币银行学（第四版）），黄达，中国人民大学出版社，2009年1月出版
- 2.《国际金融新编》（第四版），姜波克，复旦大学出版社，2008年8月出版

第二部分 微观金融

- 一、公司财务概述
 - (一) 什么是公司财务
 - (二) 企业的组织形式
 - (三) 公司制企业的目标
 - (四) 公司财务与金融市场
- 二、财务报表分析
 - (一) 会计报表
 - (二) 财务比率分析
- 三、金融市场与净现值
 - (一) 现金流与折现
 - (二) 净现值法则
 - (三) 金融市场与分离定理
 - (四) 债券定价与股票定价
- 四、资本预算
 - (一) 投资决策方法
 - (二) 增量现金流
 - (三) 净现值法则的应用
 - (四) 敏感性分析、场景分析与盈亏平衡分析
- 五、资本市场概述
 - (一) 证券市场
 - (二) 金融工具
- 六、风险、收益与资产组合理论
 - (一) 风险与收益的度量
 - (二) 效用函数与无差异曲线

- (三) 最优资产组合选择
- (四) 资产组合边界与均值-方差有效前沿
- (五) 引入无风险资产后的最优资产组合选择

七、资本资产定价理论

- (一) 资本资产定价模型的核心假设
- (二) 期望收益—贝塔关系
- (三) 资本市场线与证券市场线
- (四) 系统性风险与非系统性风险

八、套利定价理论

- (一) 因素模型与指数模型
- (二) 套利组合的实现条件
- (三) 套利定价理论
- (四) 套利定价理论与资本资产定价模型的区别

九、风险、资本成本与资本预算

- (一) 贝塔系数与资本成本
- (二) 公司资本成本与项目资本成本
- (三) 加权平均资本成本

十、有效市场理论与公司融资决策

- (一) 有效市场理论的概念
- (一) 有效市场理论的类型及其对交易策略的影响
- (二) 有效市场理论对公司财务行为的政策含义

十一、资本结构理论

- (一) 资本结构与公司价值
- (二) 无税条件下的 MM 定理
- (三) 引入企业所得税的 MM 定理
- (四) 破产成本理论概述
- (五) 优序融资理论概述

十二、有杠杆企业的价值评估与资本预算

- (一) 调整净现值法 (APV)
- (二) 权益现金流法 (FTE)
- (三) 加权平均资本成本法 (WACC)
- (四) APV、FTE 和 WACC 的比较
- (五) 贝塔系数与财务杠杆

参考书:

1. 《投资学 (第二版)》, 张宗新, 复旦大学出版社, 2009 年出版
2. 《公司理财精要版 (原书第 9 版)》, 斯蒂芬 A. 罗斯, 伦道夫 W. 威斯特菲尔德, 布拉德福德 D. 乔丹著, 方红星、徐强国、赵银德译, 机械工业出版社, 2010 年出版