

2018 年复旦大学经济学院学术学位硕士研究生入学考试

801 经济学综合基础（金融）考试大纲

经济学综合基础（金融）的考试内容包括四部分：宏观经济学、微观经济学、政治经济学、金融学。

第一部分 宏观经济学

同 856 经济学综合基础：第一部分 宏观经济学

第二部分 微观经济学

同 856 经济学综合基础：第二部分 微观经济学

第三部分 政治经济学

同 856 经济学综合基础：第三部分 政治经济学

第四部分 金融学

一、考试要求

测试考生对投资学、公司金融学、货币银行学、国际金融学相关的基本概念、基础理论的掌握及运用能力。

二、考试大纲

（一）投资学

1、金融市场与机构

- (1) 金融市场类别与金融工具
- (2) 证券交易和监管机制
- (3) 金融机构

2、投资组合理论

- (1) 风险与收益的度量
- (2) 风险偏好
- (3) 均值方差分析
- (4) 资产组合选择与管理
- (5) 投资组合业绩评价

3、均衡资本市场理论

- (1) 资本资产定价模型
- (2) 无套利定价理论及因素模型
- (3) 有效市场假说及行为金融理论
- (4) 证券收益的实证分析（包括：CAPM, APT, Fama-French 多因子模型）

- 4、普通股价值分析
 - (1) 收入资本化法与普通股价值分析
 - (2) 股息贴现模型
 - (3) 市盈率模型
 - (4) 股票投资的配置策略
- 5、固定收益证券
 - (1) 债券的价格与收益
 - (2) 利率的期限结构
 - (3) 利率风险管理
 - (4) 信用风险和信用衍生产品
- 6、远期、期货、期权与其它衍生证券
 - (1) 远期
 - (2) 期货
 - (3) 互换
 - (4) 期权定价理论和运用

(二) 公司金融学

- 1、财务报表分析
 - (1) 会计报表
 - (2) 财务比率分析
- 2、资本预算
 - (1) 现金流与折现
 - (2) 投资决策方法比较
 - (3) 自由现金流
 - (4) 项目净现值
 - (5) 项目系统性风险
 - (6) 实物期权
- 3、资本成本
 - (1) 普通股成本
 - (2) 债务成本
 - (3) 加权平均资本成本 (WACC)
- 4、资本结构
 - (1) 税、破产和资本结构
 - (2) 管理者动机、信息不对称和资本结构
 - (3) 目标资本结构
- 5、股利政策
 - (1) 股利政策理论
 - (2) 股利政策实践
- 6、营运资金管理
 - (1) 营运资本政策
 - (2) 现金和有价证券管理
 - (3) 应收账款管理
 - (4) 短期融资的方式、原则和策略
- 7、收购与兼并

- (1) 公司估值
 - (2) 并购动因及效应
 - (3) 杠杆收购
 - (4) 并购理论
- 8、公司治理
- (1) 代理问题
 - (2) 剥夺问题
 - (3) 公司治理机制

(三) 货币银行学

- 1、金融体系概览
- (1) 金融体系的构成和功能
 - (2) 各类金融机构的主要功能
- 2、货币与货币制度
- (1) 货币的本质与职能
 - (2) 货币制度的演变
 - (3) 货币的层次与计量
- 3、商业银行
- (1) 商业银行业务及其创新
 - (2) 商业银行的风险管理
 - (3) 银行业监管及巴塞尔协议
 - (4) 商业银行的信用创造与收缩
- 4、中央银行
- (1) 中央银行职能和业务
 - (2) 中央银行的资产负债表
 - (3) 存款创造与货币供给
 - (4) 货币供给的决定因素
- 5、金融创新与金融监管
- (1) 金融抑制与深化
 - (2) 金融创新与金融风险
 - (3) 金融监管理论和金融监管措施
- 6、货币政策
- (1) 货币政策的目标和工具
 - (2) 货币政策操作和传导机制
 - (3) 货币政策效果
- 7、货币理论
- (1) 货币供给理论
 - (2) 货币需求理论
 - (3) 通货膨胀与通货紧缩

(四) 国际金融学

- 1、国际收支与国际收支平衡表
- (1) 国际收支及国际收支平衡表
 - (2) 国际收支失衡及其调节

2、外汇与汇率

- (1) 国际金融市场
- (2) 汇率与汇率制度

3、汇率理论

(1) 汇率水平决定理论（包含购买力平价、利率平价、国际收支说、货币分析方法等理论）

(2) 汇率制度选择理论（包含小国及大国条件下的蒙代尔-弗莱明模型、三元悖论等理论）

4、国际收支内外部均衡

- (1) 内外部均衡的冲突
- (2) 内外部均衡冲突的调节原则
- (3) 内外部均衡调节的经典理论
- (4) 开放经济下的政策搭配理论

5、外汇管理

- (1) 外汇直接管制
- (2) 汇率制度选择
- (3) 外汇储备管理
- (4) 外汇市场干预

6、国际资本流动与金融危机

- (1) 国际资本流动
- (2) 债务危机、银行危机、货币危机以及次贷危机

7、国际金融协调与合作

- (1) 国际货币协调的理论
- (2) 国际货币协调的主要问题及制度安排
- (3) 货币国际化的理论与实践
- (4) 区域货币协调的理论与实践