

2023 年石河子大学研究生复试科目考试大纲

金融市场学

《金融市场学》是为金融硕士专业学位研究生入学考试而设置的具有选拔功能的复试科目。要求学生重点掌握货币市场、资本市场、债券市场、股票市场、证券投资基金市场、外汇市场、保险市场、衍生工具市场的基本理论、基本知识和基本技能，具备发现问题、分析问题和解决现实金融问题的能力。

一、考试内容

1. 货币市场

考试内容

- 1) 货币市场
- 2) 短期借贷市场
- 3) 同业拆借市场
- 4) 回购市场
- 5) 商业票据市场
- 6) 银行承兑票据市场
- 7) 大额可转让定期存单市场
- 8) 短期政府债券市场
- 9) 货币市场共同基金市场

考试要求

- 1) 了解货币市场的定义及其结构，理解各子市场在货币市场的地位
- 2) 掌握同业拆借市场、回购市场、银行承兑汇票市场、商业票据市场、大额可转让存单市场、短期政府债券市场、货币市场共同基金市场的基本交易原理

2. 资本市场

考试内容

- 1) 资本市场概述
- 2) 股票市场
- 3) 债券市场

4) 投资基金市场

考试要求

- 1) 了解资本市场的定义及其结构，理解各子市场在资本市场的地位
- 2) 掌握股票市场、债券市场、投资基金的基本知识

3. 债券市场

考试内容

- 1) 债券的概念与特征
- 2) 债券的种类
- 3) 债券一级市场
- 4) 债券二级市场

考试要求

- 1) 了解债券投资面临的风险
- 2) 掌握我国债券市场的现状与问题
- 3) 理解债券利率的决定因素
- 4) 掌握债券定价原理、影响债券价格的因素
- 5) 掌握债券收益率

4. 股票市场

考试内容

- 1) 股票的概念与特征
- 2) 股票的种类
- 3) 普通股和优先股
- 4) 股票一级市场
- 5) 股票二级市场
- 6) 二板市场

考试要求

- 1) 了解股票投资的风险
- 2) 理解普通股票的定价的方法及股票价格的分析方法
- 3) 掌握股票市场的结构与功能
- 4) 掌握股票的发行方式和交易方式

5) 掌握影响股票价格的因素

5. 证券投资基金市场

考试内容

1) 投资基金的概念与种类

2) 投资基金的设立和募集

3) 投资基金的运作与投资

考试要求

1) 了解证券投资基金市场的运作机制

2) 理解证券投资基金市场所起的作用与影响

3) 掌握证券投资基金的分类

4) 掌握投资基金的发行条件、价格确定

6. 外汇市场

考试内容

1) 外汇与汇率

2) 外汇市场的涵义、特点

3) 外汇市场的构成

4) 外汇市场的交易方式

5) 世界主要外汇市场

考试要求

1) 了解外汇市场的功能及运行机制

2) 掌握汇率的决定与变动的因素

3) 掌握外汇市场的各种交易方式

7. 保险市场

考试内容

1) 保险市场的含义、构成要素、特征、功能及分类

2) 保险市场的需求与供给

3) 保险市场与证券市场的关系

考试要求

1) 了解保险市场运作

- 2) 理解保险商品及定价
- 3) 掌握保险市场分类
- 4) 掌握保险市场的需求与供给的影响因素

8. 衍生工具市场

考试内容

- 1) 金融衍生工具的定义、种类、特点
- 2) 金融远期合约
- 3) 金融期货市场
- 4) 金融期权
- 5) 金融互换
- 6) 其他金融衍生工具市场

考试要求

- 1) 了解衍生工具市场存在与发展的原因
- 2) 理解远期、互换、期货、期权的异同点
- 3) 掌握影响期权价格的因素
- 4) 掌握远期、互换、期货、期权的运用

9. 金融全球化与金融市场创新

考试内容

- 1) 金融全球化发展的客观趋势
- 2) 金融全球化进程中的金融市场创新
- 3) 中国金融市场发展展望

考试要求

- 1) 了解金融全球化的表现形式和二元效应
- 2) 理解金融全球化与金融市场创新的互动关系
- 3) 掌握金融市场创新的技能
- 4) 把握金融全球化发展的趋势
- 5) 展望中国金融市场发展

二、考试方法和考试时间

硕士研究生入学考试复试科目《金融市场学》考试为闭卷笔试，考试时间为 2 小时。试卷务必书写清楚、规范、工整。所有答案均写在答题纸上。

三、试卷结构：

1. **试卷满分：**100 分
2. **题型结构：**名词解释；简答题；论述题。

四、主要参考教材（参考书目）

《金融市场学》第 2 版，朱新蓉主编，高等教育出版社，2016。

《金融市场学》第 5 版，张亦春、郑振龙、林海主编，高等教育出版社，2018。