

《证券投资学》考试大纲																											
适用专业名称：金融硕士																											
科目代码及名称	考试大纲																										
证券投资学	<p>一、 考试目的与要求</p> <p>测试考生对证券市场的基础知识和基本理论，证券市场的架构和交易工具、运作机制和运行规律，证券投资的收益、风险之间的关系和有价值证券的定价原理、以及证券投资的分析方法和管理方法的理解掌握程度，对知识的运用能力；要求考生准确记忆基本概念，理解基本理论，并能妥善运用到综合题目的分析中，具有较强的分析和解决证券投资实际问题的能力；要求考生对最新的证券投资动态有一定了解。</p> <p>二、 试卷结构（满分 100 分）</p> <p>内容比例：</p> <table><tr><td>证券投资要素</td><td>约 10 分</td></tr><tr><td>证券市场的运行和管理</td><td>约 20 分</td></tr><tr><td>证券交易</td><td>约 10 分</td></tr><tr><td>证券投资的收益和风险</td><td>约 20 分</td></tr><tr><td>证券投资对象分析</td><td>约 10 分</td></tr><tr><td>证券投资的基本分析</td><td>约 10 分</td></tr><tr><td>证券投资的技术分析</td><td>约 10 分</td></tr><tr><td>现代证券投资理论</td><td>约 10 分</td></tr></table> <p>题型比例：</p> <table><tr><td>客观题</td><td>约40分</td></tr><tr><td>1. 简答题</td><td>约20分</td></tr><tr><td>2. 名词解释题</td><td>约20分</td></tr><tr><td>主观题</td><td>约60分</td></tr><tr><td>1. 论述题</td><td>约60分</td></tr></table> <p>三、 考试内容与要求</p>	证券投资要素	约 10 分	证券市场的运行和管理	约 20 分	证券交易	约 10 分	证券投资的收益和风险	约 20 分	证券投资对象分析	约 10 分	证券投资的基本分析	约 10 分	证券投资的技术分析	约 10 分	现代证券投资理论	约 10 分	客观题	约40分	1. 简答题	约20分	2. 名词解释题	约20分	主观题	约60分	1. 论述题	约60分
证券投资要素	约 10 分																										
证券市场的运行和管理	约 20 分																										
证券交易	约 10 分																										
证券投资的收益和风险	约 20 分																										
证券投资对象分析	约 10 分																										
证券投资的基本分析	约 10 分																										
证券投资的技术分析	约 10 分																										
现代证券投资理论	约 10 分																										
客观题	约40分																										
1. 简答题	约20分																										
2. 名词解释题	约20分																										
主观题	约60分																										
1. 论述题	约60分																										

	<p>（一）证券投资概述</p> <p>考试内容</p> <p>证券投资要素。</p> <p>考试要求</p> <ol style="list-style-type: none">1. 掌握投资主体和客体。2. 理解证券中介机构。 <p>（二）证券市场</p> <p>考试内容</p> <p>证券市场的运行和管理</p> <p>考试要求</p> <ol style="list-style-type: none">1. 掌握证券发行市场：证券发行市场的结构特点、股票发行市场、债券发行市场。2. 熟悉证券流通市场：证券交易所、场外交易市场、第二板市场。3. 掌握证券市场监管的主要内容。4. 综合运用以上内容进行合理地分析和论述。 <p>（三）证券交易</p> <p>考试内容</p> <p>证券交易程序和方式。</p> <p>考试要求</p> <ol style="list-style-type: none">1. 理解证券交易程序。2. 掌握证券交易委托方式：市价委托指令、限价委托指令、停止损失委托指令、停止损失限价委托指令。3. 理解证券交易方式。4. 综合运用以上内容进行合理地分析和论述。 <p>（四）证券投资收益与风险</p> <p>考试内容</p>
--	--

证券投资的收益和风险。

考试要求

1. 理解证券投资的收益。
2. 掌握证券投资的**风险**：系统风险、非系统风险、收益和风险的关系。
3. 掌握证券风险的**衡量**：单一证券风险的衡量、证券组合风险的衡量、系统风险的衡量。
4. 综合运用以上内容进行合理地分析和论述。

（五）证券投资对象分析

考试内容

证券投资对象分析。

考试要求

1. 掌握债券分析。
2. 掌握股票分析：股票的理论价格、影响股票价格的因素、股票价格指数。
3. 其他投资工具分析：优先认股权、认股权证、可转换证券。
4. 综合运用以上内容进行合理地分析和论述。

（六）证券投资的基本分析

考试内容

证券投资的基本分析。

考试要求

1. 掌握经济分析：信息的内容及来源、宏观经济分析、行业分析、公司分析。
2. 理解财务分析：企业主要的财务报表、财务报表的分析方法、财务比率分析。
3. 综合运用以上内容进行合理地分析和论述。

（七）证券投资的技术分析

考试内容

证券投资的技术分析。

考试要求

1. 理解证券投资技术分析理论。
2. 掌握证券投资技术分析实务。
3. 综合运用以上内容进行合理地分析和论述。

(八) 现代证券投资理论

考试内容

现代证券投资理论。

考试要求

1. 现代证券投资理论的产生与发展、证券组合理论。
2. 掌握资本资产定价模型。
3. 掌握资本资产套价理论。
4. 综合运用以上内容进行合理地分析和论述。

参考书目：

《证券投资学》，霍文文主编，高等教育出版社，2017 年。