

北京大学金融经济学考研专业课复习指南 PDF转换可能丢失图片或格式，建议阅读原文

https://www.100test.com/kao_ti2020/490/2021_2022__E5_8C_97_E4_BA_AC_E5_A4_A7_E5_c67_490727.htm 一、课程概述：本

课程是光华管理学院金融学专业研究生入学的专业课(金融学)辅导课程。讲授理论金融经济学基础，并对出现在《金融学》、《证券投资学》、《公司财务》等课程中来源于现代理论金融经济学中的各种原理、方法纳入统一的理论框架，使学生对它们有更深刻的理解。现代金融经济学中最重要的是无套利假设和一般经济均衡框架。所研究的中心问题是在不确定的金融市场环境下对金融资产定价。中心结果是资产定价基本定理。证券组合选择分析、资本资产定价模型

(CAPM)、套利定价理论 (APT)、期权定价理论、有效市场理论、利率期限结构等都是这一框架中围绕这一中心结果的组成部分。

二、课程目标：本课程针对光华学院研究生考试常出现的，力图在基本的数学要求下阐明基本经济思想，使学生对研究生金融学的基本数学模型框架和研究方法有较全面深入的了解。

三、真题分析 1、分值：60' (15' *4) 专业课 150分 微观经济学 90分(60%) 金融学 60分(40%) 2、题型：问答题 计算题 3、考察内容 货币金融学、资产定价、公司理财、衍生品。重点：货币金融学：货币政策，财政政策，国内热点 资产定价：CAPM，资产组合，APT 公司理财：MM定理(公司结构)，股利政策，项目投资 衍生品：B-S期权定价公式，二叉树模型，实物期权，期权组合策略 四、内容提要：

1.引言和金融经济学基本思想 2.货币的时间价值和项目投资 3.有效市场理论 3.Markowitz 证券组合选择理论和资本资产定价

1.引言和金融经济学基本思想 2.货币的时间价值和项目投资 3.有效市场理论 3.Markowitz 证券组合选择理论和资本资产定价

1.引言和金融经济学基本思想 2.货币的时间价值和项目投资 3.有效市场理论 3.Markowitz 证券组合选择理论和资本资产定价

模型 4.Ross 的套利定价理论 (APT) 和资产定价基本定理 5.公司财务的 Modigliani--Miller 定理 6.二期证券市场的基本模型和线性定价法则 7.Black--Scholes 期权定价理论 8. 货币银行学

五、书目以及网络资源： 1.Zvi Bodie, Robert C. Merton 刘力 《财务管理学》 罗斯 《公司理财》 博迪 《投资学》 姚长辉 《货币金融学》 赫尔 《期权期货及其它衍生品》 2

、 www.gsmer.net 光华人 100Test 下载频道开通，各类考试题目直接下载。详细请访问 www.100test.com