

# 甘肃省高等教育自学考试 课程考试大纲

专业名称：金融学（专升本）

专业代码：020301K

课程名称：金融市场学（00077）



甘肃省高等教育自学考试委员会 制定  
2024年3月

# 《金融市场学》自学考试大纲

## 1. 课程性质与设置目的

### (1) 课程基本信息

课程名称：金融市场学（第2版）

教材信息：韩国文 张彻 编著 机械工业出版社 2020.7

课程代码：00077

课程类别：统考课程

总学分：5 学分

适用专业：金融学

### (2) 课程的性质与任务

《金融市场学》是金融专业的核心主干课之一，也是经济学类和管理类专业的必修课。金融市场学是研究市场经济条件下金融市场运行机制及其各主体行为规律的科学。金融市场学作为金融专业专升本的专业主干课，旨在使学生全面掌握市场经济条件下金融市场运行的原理和规律，提高学生运用所学理论、知识和方法分析解决金融市场相关问题的能力，适应社会主义市场经济对于人才的要求。

### (3) 课程学习目标

通过本课程的教学，使学生掌握金融市场的基本理论、基本知识和基本技能，掌握金融市场的各种运行机制（包括利率机制、汇率机制等价格机制及风险机制、监管机制）、金融资产的定价方法（包括货币资金、外汇、股票、债券、远期、期货、期权等）、主要金融变量的相互关系、各主体的行为（包括筹资、投资、套期保值、套利、政策行为和监管行为）、金融市场的创新（包括资产证券化、碳金融市场等），并能运用所学理论、知识和方法分析解决金融市场的相关问题，达到金融专业专升本培养目标的要求，为日后进一步学习、理论研究和实际工作奠定扎实的基础。

## 2. 课程内容和考核目标

### 第一章 金融市场概述

#### 【学习目标】

1. 掌握金融市场的定义，理解金融市场的功能。
2. 掌握金融市场的不同分类。
3. 理解金融市场的发展趋势。

#### 【学习内容】

1. 金融市场的概念和功能
2. 金融市场的构成要素
3. 金融市场的类型

#### 4. 金融市场的发展趋势

##### 【学习重点难点】

本章重点：金融市场的分类。

本章难点：金融市场的功能和发展趋势。

### 第二章 货币市场

##### 【学习目标】

1. 了解货币市场的特点、功能，了解货币市场的参与者，理解货币市场收益率的计算方法。

2. 理解货币市场各个子市场的定义、特点、作用，理解各个子市场的交易机制。

##### 【学习内容】

1. 货币市场概述
2. 同业拆借市场
3. 回购市场
4. 商业票据市场
5. 汇票市场
6. 大额可转让定期存单市场
7. 短期政府债券市场
8. 货币市场共同基金市场

##### 【学习重点难点】

本章重点：货币市场各个子市场的运行机制和作用。

本章难点：收益率的计算，银行承兑汇票的产生过程。

### 第三章 资本市场

##### 【学习目标】

1. 理解股票的定义、分类以及股东的权利，熟悉我国的股票市场。
2. 理解股票价格指数的计算。
3. 理解国债的定义、分类以及发行和流通方式。
4. 了解公司债券的分类及债券契约和债券等级。
5. 了解证券投资基金的定义、分类及特点，理解不同基金的投资策略。

##### 【学习内容】

1. 股票市场
2. 债券市场
3. 证券投资基金市场

##### 【学习重点难点】

本章重点：股票一级市场和二级市场、国债和公司债券的特点、证券投资基金收益及运

作方式。

本章难点：股票价格指数的计算。

#### 第四章 外汇市场

##### 【学习目标】

1. 了解外汇市场的含义及分类。
2. 了解外汇市场的构成要素和交易方式。

##### 【学习内容】

1. 外汇与汇率
2. 外汇市场的构成要素
3. 外汇市场的交易方式

##### 【学习重点难点】

本章重点：即期外汇交易、远期外汇交易、掉期交易、套汇交易。

本章难点：掉期交易、套利交易。

#### 第五章 黄金市场

##### 【学习目标】

1. 理解黄金市场的特点、分类与功能。
2. 理解黄金价格的影响因素。
3. 熟悉黄金市场的交易品种与投资策略。

##### 【学习内容】

1. 黄金市场概述
2. 黄金价格
3. 黄金市场投资

##### 【学习重点难点】

本章重点：黄金市场的特点；黄金价格。

本章难点：影响黄金价格的因素。

#### 第六章 金融衍生品市场

##### 【学习目标】

1. 了解金融衍生品市场的产生和发展。
2. 理解金融远期合约的特点和功能，掌握远期利率协议结算金的计算。
3. 掌握外汇期货合约定义。
4. 掌握金融期权合约的盈亏分布。
5. 掌握金融互换的定义、特点以及货币互换和利率互换的计算。

##### 【学习内容】

1. 金融衍生品市场的产生和发展

2. 金融远期市场
3. 金融期货市场
4. 金融期权市场
5. 金融互换市场

**【学习重点难点】**

本章重点：各种金融衍生品相关问题的计算。

本章难点：各种金融衍生品之间的区别和联系。

## 第七章 资产证券化市场

**【学习目标】**

1. 理解资产证券化的定义和特征。
2. 掌握资产证券化的一般程序。
3. 掌握资产证券化的分类。

**【学习内容】**

1. 资产证券化概述
2. 抵押支持证券
3. 资产支持证券

**【学习重点难点】**

本章重点：资产证券化的程序；资产证券化的分类。

本章难点：资产证券化的风险。

## 第八章 碳金融市场

**【学习目标】**

1. 了解碳金融的产生背景，掌握碳金融相关的基本概念。
2. 掌握碳金融发展的理论基础及碳金融市场交易工具和交易机制。

**【学习内容】**

1. 全球气候变化和碳金融的产生
2. 碳金融市场构成和交易机制
3. 黄金市场投资

**【学习重点难点】**

本章重点：碳金融相关基本概念、基本理论，碳金融、碳远期、碳期货和碳期权等概念。

本章难点：碳金融市场交易工具及交易机制、清洁发展机制和联合履约机制。

## 第九章 发行市场

**【学习目标】**

1. 了解证券发行市场的含义、特点、参与者及功能。

2. 理解证券发行的审核制度、信息披露的标准及意义。
3. 了解证券发行的各种方式。

**【学习内容】**

1. 证券发行市场概述
2. 证券发行的管理
3. 证券发行方式与股票发行程序
4. 债券发行方式与程序

**【学习重点难点】**

本章重点：证券发行信息披露的标准与意义，证券发行的各种方式。

本章难点：证券发行的各种方式。

## 第十章 流通市场

**【学习目标】**

1. 理解流通市场的功能，熟悉证券流通市场的形式。
2. 熟悉市场交易机制的各项内容，了解关于市场交易机制的理论模型。
3. 理解不同交易机制对金融市场功能的影响。

**【学习内容】**

1. 流通市场概述
2. 流通市场交易程序及方式
3. 流通市场的交易机制
4. 交易机制与金融市场功能

**【学习重点难点】**

本章重点：证券流通市场交易机制的各项内容，不同交易机制对金融市场功能的影响。

本章难点：指令驱动机制与报价驱动机制的区别，各种保证金的含义。

## 第十一章 利率机制

**【学习目标】**

1. 理解利率的概念，掌握各种金融工具到期收益率的计算方法，掌握各种利率的换算。
2. 理解决定利率的各种因素。
3. 理解收益率曲线及利率期限结构理论。

**【学习内容】**

1. 利率的含义及其计算
2. 利率水平的决定
3. 利率的结构

**【学习重点难点】**

本章重点：利率的计算、利率决定理论、利率换算。

本章难点：到期收益率的计算。

## 第十二章 债券和股票的内在价值

### 【学习目标】

1. 了解影响债券内在价值的因素。
2. 掌握债券的内在价值、久期和凸性的计算。
3. 了解影响股票内在价值的因素。
4. 掌握股息贴现模型和市盈率模型。

### 【学习内容】

1. 债券的内在价值
2. 股票的内在价值
3. 黄金市场投资

### 【学习重点难点】

本章重点：利用现金流贴现法计算各种债券的价值；久期和凸性的相关知识；股息贴现模型；市盈率模型。

本章难点：久期和凸性的计算；市盈率模型。

## 3. 有关说明和实施要求

### （一）考核目标

《金融市场学》总学时 60 学时，学分 5 分。

考生对考试范围内的各章节所涉及的基本概念、原理、方法应达到牢固掌握的程度。需要达到以下几方面要求：

- （1）识记：能正确认识和表述术语、原理、基本理论，能进行正确的选择和判断。
- （2）领会：能将所学知识加以解释、归纳，能领悟某一概念或原理与其他概念或原理之间的联系，理解其引申意义，并能做出正确的表述和解释。
- （3）简单应用：能用所学的概念、原理、方法正确分析和解决较简单问题，具有分析和解决一般问题的能力。
- （4）综合应用：能灵活运用所学过的知识，分析和解决比较复杂的问题，具有一定解决实际问题的能力。

### （二）关于本课程考试的规定

1. 考试方式为笔试、闭卷，考试时间 150 分钟；满分 100 分，60 分及格。
2. 本课程考试题型有 5 种，分别为单项选择题、多项选择题、判断题、简答题、论述题。
3. 本课程考试卷面中，试题的难度可分为：易、较易、较难、难四个等级，每份试卷中不同难度试题的分数比例一般为 2:3:3:2。
4. 本课程考试卷面中，识记、领会、简单应用、综合应用 4 类题目，各占分数的 20%、30%、30%、20%。

(三) 参考书目

- [1] 张亦春, 郑振龙, 林海. 金融市场学. 北京: 高等教育出版社. 2020
- [2] 中国银行间市场交易商协会教材编写组. 现代金融市场理论与实务(上、下册). 北京: 北京大学出版社. 2019