

经济学

分支

- 基本原理
 - 一价定律
 - 有效市场假说
 - 行为金融学
- 资产组合理论
 - 资产组合理论概述
 - 马科维茨资产组合模型
 - 最优资产组合的确定
- 资本资产定价模型CAPM
- 因子模型与套利定价理论
- 使用现值因子对已知现金流进行价值评估
- 零息债券定价和付息债券定价
- 影响债券定价的因素：市场利率、到期期限、债券价格的时间轨迹、收益率、债券利息率
- 债券收益率：当期收益率、到期收益率、持有期收益率、总收益率
- 利率期限结构理论
- 固定收益证券的风险度量：久期与凸性
- 股票定价
- 股利贴现模型
- 自由现金流贴现模型
- 远期合约
- 期货合约
- 期权的基本概念与投资策略
- 期权定价理论
- 期权的应用
- 其他衍生证券

资产定价（投资管理）

金融经济学

金融体系

- 金融体系的功能
 - 跨时空转移资源
 - 管理风险
 - 清算支付和结算支付
 - 归集资源并细分股份
 - 提供信息
 - 设法解决激励问题
- 金融中介
 - 银行、其他存款储蓄机构、保险公司、养老金与退休基金、共同基金、投资银行、风险投资企业、资产管理企业、信息服务企业
- 金融市场
 - 场内交易与场外交易（按信息透明度）
 - 货币市场与资本市场（按交易工具的不同期限）
 - 票据市场、证券市场、衍生工具市场、外汇市场与黄金市场（按不同交易标的物）
 - 现货市场与期货市场（按交割期限）
 - 地方性、全国性、区域性和国际性金融市场（按地域）
 - 中心化交易与去中心化交易（按交易结构）
- 政府与准政府组织、金融监管
 - 中央银行
 - 特殊功能的中介
 - 金融市场监管机构：银保监会、证监会
 - 区域性组织和全球性组织

公司金融

- 财务报表分析
 - 财务报表：资产负债表、利润表、现金流量表
 - 财务报表的功能
 - 财务比率分析
 - 盈利能力、营运能力、偿债能力、发展能力、综合指数分析
- 公司的融资决策
 - 公司长期的融资决策：股权、债务（银行贷款、债券）
 - 公司短期的融资决策
- 公司的投资决策
 - 公司内部投资决策：项目投资
 - 公司外部投资决策：合并、收购、新设立
- 股利策略
 - 股利策略的主要理论和假说
 - 现金股利和股票回购

货币的时间价值和风险

- 利率
 - 利率的决定因素
 - 单利与复利
 - 现值与折现
 - 折现现金流决策规则：净现值法则、内部收益率法则、投资回收期法则
 - 复合现金流
 - 通货膨胀与折现现金流分析：名义利率与实际利率
- 风险
 - 风险的概念：风险与风险规避；风险管理；风险暴露
 - 风险与经济决策：居民与企业面对的风险、政府在风险管理中的角色
 - 风险的管理过程：风险识别、风险评估、风险管理技术的选择、实施、审查
 - 风险管理机构
 - 风险与收益
 - 风险态度：风险厌恶、风险喜好和风险中性