2018-2019

对错10分

纳斯达克

选择题25分

期望组合

系统性风险

9选4

两题必做 4\*10

强弱指数

（辅修1班 公募 私募 对冲基金 关系

（专业班 套利

（专业班 股票影响的核心因素

（辅修2班 有效市场 行业分析

论述 25分

股指期货投资策略

股票策略

股票风险类型及收益

简答题还有一道是基本面分析的基本内容，还有一道是货币供应量M2的增加对股市行情的影响（辅修1班）

2017-2018年秋冬（汪炜班级）

判断题1分×10

* H股的判断
* 红筹股的判断
* 先行指标/平行指标/滞后指标的判断
* 封闭型基金的特点（待补充）
* 纳斯达克
* 交易所是会员制还是公司制——会员制
* 我国的基金是不是都是契约型——是
* 溢价发行超出票面的钱是不是归在资本公积——是

溢价发行收入计入：资本公积——股本溢价

单选题1分×10

* 债券价格的计算
* 投资收益的计算
* 先行指标/平行指标/滞后指标的判断（考了很多小题）
* 系统性风险和非系统性风险的判定
* 期望组合
* 收益率
* 股利贴现模型
* 道琼斯指数有哪些行业的成分股
* 还有一些概念性的

简答题六选四10分×4

* 证券投资的风险主要来源于哪几个方面（首先解释风险是什么，然后再叙述系统性风险和非系统性风险的定义和内容）
* 套利的时机、作用和风险
* 期权的风险和收益
* 简述效率市场理论（有效市场假说）
* 简述公司分析
* 套期保值的运用（年年考）
* 强弱指数
* 公募、私募、对冲基金关系
* 股票影响的核心因素
* 行业分析
* 基本面分析的基本内容
* 货币供应量M2的增加对股市行情的影响

论述题三选一25分×1

* 股指期货的投资策略有哪些？
* 行业分析的主要内容、作用
* 驱动股票价格涨跌的因素，并结合实际案例分析
* 股票策略
* 如何科学地做出股票投资决策
* 股票风险类型及收益
* 论述一下风险和收益的关系和应对措施
* 结合RSI指标简单阐述一下技术分析的运用
* 货币供应量M2的增加对股价的影响和传导路径

2021-2022

题型： 判断1\*10分 选择1\*10分 简答4\*10 + 15分

论述二选一 25分 判断选择：

H股在香港注册上市

次强有效市场

社会消费品零售总额是同步指标

货币政策是先行指标

封闭式基金价格受市场供求关系影响

计算题：

5年期限债券给利率求价格

基金投资者和管理人关系——委托人和代理人？所有者和经营者的关系，在我国，投资者、管理人、托管人之间是契约关系。

二级市场的组成——证券交易市场、由投资人、市场中介机构、交易所、交易结算机构组成

公司股票溢价发行部分转资本公积

行业的生命周期（成熟期）

介于传统股票和债券之间的特殊证券不包括

看涨期权的卖方收益有限和风险无限

看跌期权又称买入期权

政府主管批准建立的有形市场是哪个市场 ——？

本国在外国发行、但用本币计价的债券：欧洲债券

简答题（金融班）

投资者如何正确套利

双重股权结构的理念

简答题（辅修班）

公司估值体系有哪些方法

用杜邦分析法解析影响ROE的核心因素

**简述证券投资学课程的核心内容**

简答题（公共）

期权的买方和卖方的风险和收益（10分）

证券投资中的风险类别以及防范措施（15分）

论述题（二选一）

积极型，消极型，避险型投资的策略和要点 DCF的内涵，意义，使用范围，困难点；

结合行为金融理论和资本资产定价理论从分子端和分母端分析影响股票价格的核心因素