

中央财经大学同等学力申请硕士学位题库考试

《投资银行学》课程考试大纲

一、课程性质

《投资银行学》是关于投资银行的理论和实务的学科，投资银行学课程分别从投资银行理论、实务、监管等方面论述了现代投资银行的基本原理及具体操作，课程以投资银行的机构及业务运作实践为主线，对投资银行的实质、主要业务及其功能进行了详细论述，并对投资银行业务的发展趋势进行了预测和展望。投资银行学课程的板块包括：（1）投资银行的历史演进与组织结构；（2）投资银行的主要业务：证券发行与承销业务、经济业务、自营业务、公司并购业务；（3）投资银行的其他业务：基金管理、私募股权与风险投资；（4）投资银行的风险管理、金融创新与监管。课程内容注重理论与实际应用相结合，定量分析与定性分析相结合。课程内容涉及股票发行定价、融资融券制度、投资组合管理、风险管理理论、资产证券化等重要的金融学理论；涵盖了投资银行发展模式、自营业务创新、私募股权与风险投资的运作等实际操作中的难点。授课形式包括案例讲解与学生分组展示，加深学生对理论的认识，提高学生的理论应用的能力

投资银行学教学意义：（1）投资银行学是金融学中的一门专业课程，是学科知识体系中不可或缺的重要组成部分；（2）投资银行学涵盖较宽泛的金融学知识，有助于学生拓宽思维，培养学生的综合分析能力，有利于学生思维水平的提高；（3）投资银行学注重实务操作，促使学生运用所学知识对有关问题进行分析和操作，有利于学生的职业发展。

二、课程要求

第一章：了解投资银行的产生、发展历程与基本业务；熟悉：投资银行在金融市场上的地位，及与其他金融机构的联系与区别；掌握：投资银行的定义、功能

第二章：了解投资银行发展阶段；熟悉中国投资银行发展模式的选择、我国投资银行存在的主要问题；掌握投资银行的两种主要发展模式—分离型模式和综合性模式的特点、利弊及适用条件

第三章：了解投资银行的规模结构、人力组织形式；熟悉投资银行的组织形态与业务模式；掌握投资银行主要的组织形式以及各种组织形式的优缺点

第四章：了解证券承销程序，我国新股发行制度的改革历程；熟悉不同中介机构的职责，尽职调查的程序及内容；掌握：证券承销的概念及具体方式，股票发行定价的原理和方法

第五章：了解经纪业务的特点、基本程序；熟悉证券信用制度与融资融券，了解我国融资融券业务的发展现状；掌握经纪业务的基本含义、证券信用交易风险识别与风险管理

第六章：了解投资范围及其演变；熟悉：自营业务创新的内容、发展趋势以及其对证券公司的影响；掌握自营业务的含义、特点以及管理制度。

第七章：了解投资银行在公司并购过程中的作用；熟悉：兼并、收购的概念及其类型，公司并购的动因；掌握公司并购的类型，投资银行对目标公司的估值方法，目标公司如何实施反收购策略。

第八章：了解证券投资基金的概念、类型与主要业务领域；熟悉投资基金的设立、发行与交易；掌握投资基金定义、特征、分类

第九章：了解私募股权的运作模式、组织形式、投资机制；熟悉私募股权的发展历程；掌握私募股权的定义，以及其与私募基金等概念的区别，进一步学习风险

第十章：了解投资银行风险的概念及类型；熟悉明确系统性风险和非系统性风险的划分；掌握投资银行的业务风险及其防范措施，学会制定投资银行的风险管理策略，学会使用 VAR 描述风险

第十一章：了解金融创新的含义、动因、趋势；熟悉：几种创新的金融工具；掌握资产证券化的定义、运作与风险管理

第十二章：了解投资银行内部控制和外部监管的含义和内容；熟悉自律监管与政府监管的区别与联系；掌握政府监管的具体内容，不同监管体制的优缺点和我国投资银行业的监管制度

三、考核方式

（一）考核形式：笔试、闭卷

（二）答题时间：120 分钟

四、题型结构（满分为 100 分）

（一）名词解释（占 16%，共 4 题，每题 4 分）

（二）单项选择题（占 15%，共 15 题，每题 1 分）

（三）多项选择题（占 15%，共 10 题，每题 1.5 分）

（四）计算题（占 14%，共 1 题，每题 14 分）

（五）简答题（占 20%，共 3 题，每题 6-8 分）

（六）案例分析（占 20%，共 1 题，每题 20 分）

五、主要参考书目

1. 推荐使用教材：韩复龄著：《投资银行学》，对外经贸大学出版社，2014.4

2. 权威参考书目：

1) [美] K·托马斯·利奥：《投资银行业务指南》，北京经济科学出版社，2000

2) 王益民著编：《国泰投资银行丛书》上海；立信会计出版社，1998

3) 刘金章等著：《现代投资银行综论》，北京中国金融出版社，2000

4) [美]罗伯特·库恩著：《投资银行学》，北京北师大出版社，1996

5) 谢剑平等著：《投资银行》，台湾；台湾华泰书局，1996

6) 任映国徐洪才：《投资银行学》（第三版）北京；经济科学出版，2005

7) 王长江等：《现代投资银行学》第 1 版，北京；科学出版社，2002

六、考核内容

第一章 投资银行概述

第一节 投资银行的基本概念

第二节 投资银行业务与其他商业银行的比较

第二章 投资银行的历史演进与发展趋势

第一节 投资银行的起源与发展阶段

第二节 发达国家投资银行的历史变迁，投资银行在中国的发展

第三节 投资银行的发展模式

第三章 投资银行的组织结构

第一节 投资银行的组织形态与规模结构

第二节 投资银行的机构设置与业务模式

补充内容：小组展示“怎样才能成为优秀的投行家”

第四章 证券的发行与承销

第一节 证券发行的类型、管理体制

第二节 证券承销的程序，证券发行的风险与收益

第三节 中介机构的选择与尽职调查

第四节 股票发行的类型、定价与发行制度

第五节 股票发行定价

第六节 股票的承销方式

补充内容：小组展示“IPO的尽职调查”“IPO定价”

第五章 经纪业务

第一节 经纪业务概述

第二节 证券经纪业务的程序

第三节 证券信用制度与融资融券

第六章 自营业务

第一节 自营业务概述

第二节 券商自营业务创新

第七章 公司并购业务

第一节 公司兼并与收购的概念及其类型、企业并购的动因与效应

第二节 公司并购的程序和投资银行在并购中的作用

第三节 收购与反收购策略

补充内容：小组展示“兼并与收购案例分析”

第八章 基金管理

第一节 证券投资基金概述

第二节 投资基金的设立、发行、交易与投资组合管理

第九章 私募股权与风险投资

第一节 私募股权的概述、运作与发展历程

第二节 风险投资的概述与运作

第十章 投资银行的风险管理

第一节 投资银行风险的定义与类型

第二节 投资银行业务的风险及防范

第三节 投资银行的风险管理策略与风险管理工具（VAR）

第十一章 投资银行的金融创新

第一节 金融创新的含义、动因、趋势

第二节 金融工具的创新与资产证券化

第十二章 投资银行的内部控制和外部监管

第一节 投资银行的内部控制与自律组织

第二节 政府对投资银行的监管与我国证券市场的监管体制