

國立臺灣科技大學

九十四學年度博士班甄試招生考試試題

系所組別：管理研究所EDBA博士丙組

科 目：財務管理

總分 100 分

- 1、請說明系統風險 (Systematic Risk) 與非系統風險 (Nonsystematic Risk) 之意義，並說明CAPM (Capital Asset Pricing Model) 與資產倍它 (Beta) 係數之意義及其應用。(25分)
- 2、請列舉並分析至少三種投資方案所隱含的實質選擇權 (Real Options)。請說明實質選擇權評價 (Real Option Pricing, ROP) 方法如何解決傳統現金流量折現 (Discounted Cash Flow, DCF) 方法的限制。而實質選擇權評價係運用選擇權訂價理論 (Option Pricing Theory, OPT)，請問其問題與限制在哪裡？(25分)
- 3、請問公司治理 (Corporate Governance) 對企業的經營有那些重要影響？台灣在公司治理的議題上，有那些需要改進的地方？(25分)
- 4、請問行為財務學的主要論述為何？其與傳統財務學的主要差異為何？(25分)

