

國立台灣科技大學九十六學年度碩博士班甄試招生試題

系所組別：財務金融研究所EMBA碩士在職專班

科 目：財務金融實務

總分 100 分

- 1、你任職於國內一家頗具規模的金控公司，公司目前有一筆約 100 億元新台幣的資金可供投資之用，由於 2007 年的經濟展望不錯，公司高層希望你能組一個投資團隊於 2007 年進行金融投資。你可以針對國際或國內的金融商品為標的來進行投資，包括股票、債券、期貨、選擇權的組合均可考慮。不過，公司高層希望投資損失超過 30 億元新台幣的機率能控制在 20%以內。請你針對 2007 年國際或國內的投資環境加以分析，建議你的資產配置，及評估可能的報酬與風險，以供金控高層作最後的評估。(25 分)
- 2、你是國內知名銀行（或券商）的資深經理人員，公司經營高層為加強企業體質，希望你能協助提供一份風險管理的計畫，並於 2007 年積極推動。請以你熟悉的銀行或券商為例，說明造成該銀行或券商風險的原因主要為何，你建議如何衡量風險？針對這些風險你建議宜採取那些措施來加以控管？你認為推動這項計畫最大的困難為何？應如何克服？(25 分)
- 3、企業評價的方法有那幾種？各有何利弊？如何運用？(25 分)
- 4、不同生命週期的企業，其融資決策與股利政策該如何決定？(25 分)