

銘傳大學九十二學年度財務金融學系碩士在職專班

招生考試

財務金融分析與實務 試題

1. 資產管理者(Asset Manager)最重要的任務，在於妥善控管投資組合部份之風險暴露與期望報酬，動態控制資產管理目標與投資組合部位之調整。衍生性金融商品，則其能利用較低的成本達成那些資產管理之目的？(25%)
2. 請利用「架構圖/流程圖」之方式，說明金融資產證券化之基本架構中，債務人/借款人(Obligor)、創始機構(Originator)、受託機構(Trustee)、特殊目的公司(Special Purpose Company)、服務機構(Servicer)、信用評等機構(Rating Agency)、承銷機構(Underwriter)及投資人(Investor)間之關係。(25%)
3. 試解釋何謂 ETF(Exchange Traded Fund)？ETF 與指數期貨對於資產管理有何助益？(25%)
4. 解釋何謂風險值(Value at Risk,以下簡稱 VaR)？依據巴賽爾委員會及國際清算銀行最新之自有資本適足性管理規範，VaR 在自有資本適足性管理規範中之定位為何(試繪圖說明)？(25%)

試題完