

2012 年对外经济贸易大学金融学考研复试试题（回忆版）

本试题由 kaoyan.com 网友 yuenuo, blcuraging 提供

一、简答：

1. 基础货币的定义，央行调控基础货币的途径有哪些？
2. 一国对产品实行关税，长期内对实际汇率和名义汇率产生什么影响？
3. 简述公司金融 MM 的内容
4. 简述 CAPM 的内容，说说其缺点！
5. 写出卖出——买入期权定价公式，若标的资产不符合几何布朗运动，该定价公式是否成立？

二、计算题：

1. 持有到期 60 天，面值为 100000 元的投资者向央行贴现债券，年利率为 6%，问投资者的收益，银行的收益？
2. 某公司有 3 亿债券，以及 500 万股股票，股价为 100 元，债券的税前收益率为 10%，股票的 beta 值为 1.5. 现在公司把债券价值提高到 50%，收益率变为 12%。公司税率为 40%，国债利率为 5%，市场资产组合的风险溢价为 8%，求，调整后的股票 beta 值，以及股票的资本成本
3. 标的资产为 50 元的无红利股票，行权价格为 51 元，连续复利的情况下的年度化利率为 8%，求三个月期的欧式期权的价格，利用 BS 公式，不用计算出终值，只写公式，带入数字

三、论述题

1. 央行的政策工具除了三大宝之外，还有哪些？说明其工作原理，结合我国实际，说说其对我国房地产市场的作用
2. 互换，期货，期权，远期的优缺点，并说明公司应该在什么情况下应该寻则哪种产品？
3. 简述有效市场假说，并结合现代金融发展理论说说其局限性

以上试题来自 kaoyan.com 网友的回忆，仅供参考，纠错请发邮件至 suggest@kaoyan.com。