

対象科目：博士後期課程 ファイナンス論

【出題範囲・大項目】

- ・資産価格理論、ポートフォリオ選択理論：基礎概念、一期間モデル、デリバティブ価格。
- ・金融市場の理論的基礎：情報効率性、裁定取引、資源配分効率性、社会的厚生、マーケット・マイクロストラクチャー、異時点間均衡モデル。
- ・銀行、金融仲介と金融危機：流動性創出と銀行取り付け、モニタリングとその委託。
- ・コーポレート・ファイナンス：最適資本構成、株主還元(ペイアウト)政策。

【参考文献】

清水克俊(2016)『金融経済学』東京大学出版会。

Brealey, R., S. Myers, and F. Allen, 2016, *Principles of Corporate Finance* 12th ed., McGraw-Hill. (藤井真理子・国枝繁樹(監訳)(2014)『コーポレート・ファイナンス、第10版』上・下、日経BP社。)

Cochrane, J. H., 2005, *Asset Pricing*, revised ed., Princeton U.P.

Danthine, J-P. and J. B. Donaldson, 2014, *Intermediate Financial Theory*, Third ed., Academic Press. (祝迫得夫(監訳)、可児滋、佐野三郎、中田勇人(訳)(2007)『現代ファイナンス分析 資産価格理論』、ときわ総合サービス。)