

2010证券从业资格考试《投资分析》精讲班习题(8) PDF转换可能丢失图片或格式，建议阅读原文

[https://www.100test.com/kao\\_ti2020/647/2021\\_2022\\_2010\\_E8\\_AF\\_81\\_E5\\_88\\_B8\\_c33\\_647467.htm](https://www.100test.com/kao_ti2020/647/2021_2022_2010_E8_AF_81_E5_88_B8_c33_647467.htm) 第1页：一、单项选择题第3

页：二、多项选择题第5页：三、判断题第6页：参考答案

2010年证券从业资格全科套餐，七折优惠，并赠送100元模考卡！第八章 金融工程应用分析(答案解析) 一、单项选择题 1

1、当期货市场上不存在与需要保值的现货一致的品种时，人们会在期货市场上寻找与现货( )的品种，以其作为替代品进行套期保值 A、在功能上互补性强 B、期限相近 C、功能上比较相近 D、地域相同 2、金融工程是20世纪( )年代中后期在西方发达国家兴起的一门新兴学科。 A、60 B、70 C、80 D、90

3、VaR方法是( )开发的。 A、联合投资管理公司 B、J、P、Morgan C、费纳蒂 D、米勒 4、大多数套期保值者持有的股票并不与指数结构一致。因此，在股指期货套期保值中通常都采用( )方法。 A、互换套期保值交易 B、连续套期保值交易

C、系列套期保值交易 D、交叉套期保值交易 5、分解、组合和整合技术都是对金融工具的结构进行整合，其共同优点在于( ) A、针对性和固定性 B、灵活、多变和应用面广 C、步骤的科学性 D、成熟、稳定

6、关于MM定理，以下说法不正确的是( )。 A、也称套利定价技术 B、MM是诺贝尔经学奖获得者莫格里亚尼和米勒的姓氏的第一个字母 C、它认为企业的市场价值与企业的资本结构有关 D、它假设存在一个完善的资本市场，使企业实现市场价值最大化的努力最终被投资者追求最大投资收益的对策所抵消

7、关于套利，以下说法正确的是( )。 A、套利最终盈亏取决于两个不同时点的价格变

化 B、套利获得利润的关键是价差的变动 C、套利和期货投机是截然不同的交易方式 D、套利属于单向投机 8、1998年美国金融学教授( )首次给出了金融工程的正式定义：金融工程包括新型金融工具与金融工序的设计、开发与实施，并为金融问题提供创造性的解决办法。 A、费纳蒂 B、格雷厄姆 C、费舍 D、法默 100Test 下载频道开通，各类考试题目直接下载。详细请访问 [www.100test.com](http://www.100test.com)