

2024 年期货从业资格《期货投资分析》试题及答案

1、[题干]下列说法错误的是()。

- A. 美元标价法是以美元为标准折算其他各国货币的汇率表示方法
- B. 20 世纪 60 年代以后，国际金融市场间大多采用美元标价法
- C. 非美元货币之间的汇率可直接计算
- D. 美元标价法是为了便于国际进行外汇交易

【答案】C

【解析】20 世纪 60 年代以后，欧洲货币市场迅速发展起来，国际金融市场间的外汇交易量迅猛增加，为便于国际进行外汇交易，银行间的报价普遍采用“美元标价法”，即以一定单位的美元为标准来折算应兑换多少其他各国货币的汇率表示方法。世界各金融中心的国际银行所公布的外汇牌价都是美元兑其他国家主要货币的汇率，非美元货币之间的汇率，则通过各自对美元的汇率套算。

2、[题干]某公司的可转换债券的面值为 1000 元，转换价格是 40 元，当前市场价格为 1200 元，其标的股票当前的市场价格为 45 元，则下列计算正确的有()。

- A. 该债券的转换比例为 25
- B. 该债券当前的转换价值为 1125 元
- C. 该债券当前的转换平价为 48 元

D. 该债券转换升水 75 元

正确【答案】 ABCD

3、[题干]跨商品套利的基本条件包括()。

A. 高度的相关和同方向运动

B. 波动程度相当

C. 投资回收需要一定的时间周期

D. 有一定资金规模量的要求

【答案】 ABCD 跨商品套利的理论基础与其他的套利交易相同。跨商品套利的主导思想是促使价格从非正常区域回到正常区域内，追逐商品价格之间的价差利润，需要具备一定的条件。A、B、C、D 四项是实现跨商品套利的基本条件。

4、[题干]下列说法错误的是()。

A. 同方差性假定的意义是指每个样本残差 σ 的方差，不随样本的变化而变化

B. 同方差性指 $\sigma = \text{常数}$

C. 同方差性指 $\sigma = 0$

D. 同方差性是一元线回归模型设定的假定条件

【答案】C 同方差性指 a =常数。

以上内容仅为本文档的试下载部分，为可阅读页数的一半内容。
如要下载或阅读全文，请访问：

<https://d.book118.com/418003024110006072>