

期货从业资格考试 QQ 群: 436786953

2019 年 11 月期货投资分析考试真题及答案

根据已知样本, 建立人均收入 X 时人均消费支出 Y 的回归模型为()

A. 0.75%

B. 7.5%

C. 2%

D. 0.2%

参考答案: B

评价交易模型性能优劣的指标不包括()

A. 最大回撤

B. 年化收益

C. 盈利速度

D. 夏普比率

参考答案: ABCD

若变量 X 与变量 Y 的相关系数为(), 则表明二者不存在线性关系

A. -1



考证就上233网校APP

报考指导、学习视频、免费题库一手掌握

B.0

C.1

D. ∞

参考答案 : B

某资产管理管理机构发行挂钩于上证 50 指数的理财产品, 其收益率为 $1\% + 20\% \times \max(\text{指数收益率}, 10\%)$, 该机构发行这款产品后需对冲价格风险, 合理的做法是()

A. 买入适当头寸的上证 50 股指期货

B. 卖出适当头寸的上证 50 股指期货

C. 卖出适当头寸的 50ETF 认购期权

D. 买入适当头寸的 50ETF 认购期权

参考答案 : AC

参考解析: 该理财产品的收益率和上证 50 指数收益率挂钩, 当指数收益率高于 10% 时, 理财产品收益率为 $(1\% + 20\% \times \text{指数收益率})$; 当指数收益率低于 10% 时, 理财产品收益率为 3%, 所以该机构要对冲的是上证 50 指数上涨的风险。该机构可通过买入看涨期权和股指期货来建立盈亏平衡机制, 从而对冲价格风险。

扫描以下二维码, 下载更多期货考试资料!



考证就上233网校APP

报考指导、学习视频、免费题库一手掌握



考证就上233网校APP

报考指导、学习视频、免费题库一手掌握