

2012年武汉大学金融工程考研复试试题（回忆版）

本试题由 kaoyan.com 网友 voilavenice 提供

一、名词解释：

1. 积极的投资策略
2. caps
3. 非系统性风险

二、计算题：

1. 根据数据求 clrm 中贝塔一和贝塔二，然后解释下 X 变动会引起 Y 怎样的变动。
2. S、B 两种证券，ES=13%，标准差 20%；EB=8%，标准差 12%，求能使  $E/\sigma$  最大化的投资组合
3. 证欧式期权平价定理，标的物无收益

三、简答题：

1. 什么是多重共线性，有什么结果
2. 什么是可决系数  $R^2$ ，为什么要用  $R^2$  作为判断标准
3. 基本面分析法和技术分析法的区别
4. 期权和期货的区别和联系

四、论述题：

简述套利思想在金融工程中的运用

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。