

## 2013 年武汉大学 431 金融学综合考研试题（回忆版）

本试题由 kaoyan.com 网友 huang0828 提供

### 一、名词解释

1. 特别提款权 2. 增长年金 3. 相对购买力平价 4. 相机抉择 5. 债券 6.

敏感性分析

### 二、计算题

1. 回收期的计算（八年的现金流每年 840，假设初始投资是 3000 或是 5000，8000）

2. 一个永续现金流的投资方式，每年是多少钱（忘了），然后告诉你一个利率，问该投资方案值得你付多少钱

第二问是给定投资金额，求利率

3. 给出 A，B 两种证券的期望收益和标准差，30%的 A 和 70%的 B 构成的投资组合，求组合的期望收益以及组合的方差

4. 一个美国公司三个月后有 1800 万英镑的应收款，该公司的自主经营的年收益为 12%，给出英镑兑美元的即期利率，给出一个左高右低的掉期率，给出美国和英国两个市场的存贷和贷款利率，问题（1）如何用远期市场套期保值（2）如何用货币市场套期保值（3）什么情况下应该借款自己经营而不是投资于美国货币市场

### 三、简答

1、简述利率平价说 2、简述凯恩斯的货币需求理论 3、商业银行的谨慎监

管 4、商业银行资本结构变化及原因

5、资本流动以及固定汇率对货币政策独立性的影响，结合各国情况分析

6、回收期法的优缺点 7、中央银行作为“银行的银行”的职能是些什么

四、论述

金融创新对货币政策中介目标的的影响，以及由此对我国货币政策有效性的启示（有些记不太清了，欢迎补充更正）

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。