



第八届一本通纠错更正第一期

1.29 页第 1 题，解析过程没有问题，最后答案“选 C”改为“选 B”。

2.51 页 27 题，图和题干重合，新的不重合版本已经上传到群文件《一本通不清晰图片汇总》。

3.81 页 47 题，解析中的 272 和 232，实际上是 27 的平方和 23 的平方。

4.82 页 53 题，解析表述有误，宽跨式组合的两个期权的行权价不一致，答案仍然选 AC。

5.10 页考点四，当日结算价的计算结果保留至小数点后两位改成，当日结算价的计算结果保留至小数点后一位。

6.60 页的 13 题，将题干中的英镑兑美元的即期汇率为 1.25 改为 1.65，



解析中的括号内容（即期汇率是 $1\text{GBP}=1.25\text{USD}$ ）。

7.177 页 9 题，同学反映此题需要过程，现将过程补充如下：

解析：该公司持有英镑资产，是怕英镑贬值，那么应该是卖出英镑期货，如果英镑真的贬值，则期货空头赚的利润可以弥补英镑资产的贬值损失。

3 月 1 号：按照美元计价资产价值 $150 \times 1.89 = 283.5$ 万美元。

180 天后，该资产价值 $150 \times (1+6\%) \times 1.85$ ；期货头寸盈利 $150 \times (1.91 - 1.87) = 6$ 万美元，总计是 300.15 万美元。

收益率是 $(300.15 - 283.5) / 283.5 = 5.87\%$ 。选 D。

8.167 页 28 题，题干尾部的利率上限期权的价格为 1.6 元改为利率下限期权的价格为 1.6 元。