股價x 除息y 除權z 除息後股價= x-y 除權後股價= $\frac{x}{1+z/10}$ 除權息:先除息再除權

Sharp ratio:

5 days [5, 6, 7, 6, 8], 0.01 per year

return=[1/5, 1/6, -1/7, 1/3]

mu=0.139, sig=0.201, srd=(mu-0.01/252)/sigma, sry=sqrt(252)*srd

 $SMA_U(N)$: 過去N天的隔日漲幅平均 $SMA_D(N)$: 過去N天的隔日跌幅平均 $RSI(N)=\frac{SMA_U\times 100\%}{SMA_U+SMA_D}$ 9 days [3 1 4 3 4 5 3 6 13] [-2 3 -1 11 -2 3 7], $SMA_U=(3+1+1+3+7)/8, SMA_D=(2+1+2)/8$ RSI=75%

earnings per share $EPS=rac{稅%%10}{88\%({ ilde g} \times { ilde m})}$

資產報酬率 $ROA = rac{rac{rac{rac{Rrac{2}{3}}{2}}{2}}{rac{2}{3}}$

股東權益報酬率 $ROE = rac{rac{rac{R(8)^{3}}{1}}{rac{3}{10}}},$ 淨值 = 資產 - 負債

本益比 $(PER) = \frac{BG}{EPS}$

股價淨值比 $(PBR) = \frac{Bd}{6BP + Bd}$

殖利率 $(Yield) = \frac{BN}{BC}$

DP trading:

stage=[2 1 3 4 5 2]

init cash=10

max cash=[10 10 30 40 50 50]

max stock hold=[5 10 10 10 10 25]

畫圖:sigma橫軸,mu縱軸 minimum variance when indep: $\frac{\sigma_1^2 \alpha}{\sigma^2 +}$

REMEMBER to SQRT

talib?

EMA 指數移動平均

 $S_t = \alpha Y_t + (1 - \alpha)S^{t-1}$

Explain relationships between features and outputs

正確答案

Increase accuracy

Which is used to verify the signature of a Bitcoin transaction? ans: sender's public key

What is the total amount of Bitcoins according to its design? ans: 21000000

For block chaining, transaction signing, and Merkel tree construction in Bitcoin, which is the size (in bits) of a hash value? ans: 256

In the Bitcoin protocol, which value in a block header is determined by the transactions that a node (miner) collected? ans: Merkle Root

According to the paper published by Satoshi Nakamoto, arrange the steps in correct order to run the Bitcoin network

- (1) Nodes accept the block only if all transactions in it are valid and not already spent
- (2) New transactions are broadcast to all nodes
- (3) When a node finds a proof-of-work, it broadcasts the block to all nodes
- (4) Each node collects new transactions into a block
- (5) Each node works on finding a difficult proof-of-work for its block
- (6) Nodes express their acceptance of the block by working on creating the next block in the chain, using the hash of the accepted block as the previous hash

ans: 245316

Which is used to sign a Bitcoin transaction? ans: sender's private key

In average, how long does it take that a new block is attached to the Bitcoin block chain? ans: 10min

How long is a private key for Bitcoin or Ethereum? ans: 256

Which is computationally infeasible?

您已回答

Deriving Bitcoin address from its public key Deriving Bitcoin address from its private key

$$DIF = EMA_{close,12} - EMA_{close,26}$$

 $DEM = EMA_{DIF,9}$

$$OSC = DIF - DEM$$

RSI

$$OBV = today + OBV_{yesterday}$$

Prediction

		Positive	Negative
Groundtruth	Negative Positive	TP = 30	FN = 10
		FP = 20	TN = 940

a. Accuracy (recognition rate) 97/100

b. True positive rate (sensitivity, hit rate, recall) 3/4

c. True negative rate (specificity, selectivity) 47/48

d. False positive rate (miss rate) 1/48

e. False negative rate 1/4

f. Precision 3/5
g. F-measure 2/3

Benefit of feature selection: What are the benefits of feature selection for classification?

您已回答

Explore correlation among features

正確!

Reduce computation load

正確!

Deriving Bitcoin public key from its private key

正確答案

Deriving Bitcoin public key from its address

Which is the main reason that Ethereum mining needs GPU instead of ASIC? ans: Hash algorithm

Which algorithm implemented on large-scale quantum computers will break ECDSA of Bitcoin and Ethereum in the future? ans: Shor's

Find s such that b=as+e in the poly ring for small e: ring-LWE

Which cryptocurrency has been implemented with zero-knowledge proof?

QRL 正確!

Zcash

Bitcoin

Ethereum

Find a short nonzero vector x s.t. $Ax \equiv 0 \pmod q$ with n < m: SIS (short integer solution)

Which is NOT a zero-knowledge proof scheme to provide privacy for the blockchain technology?

正確!

EdDSA

BulletProofs

zk-SNARKs

zk-STARKs

Given bad basis, find good basis such that SVP or CVP is easier: Lattice Basis Reduction

金融科技使得金融服務具有

效率性

普及性

正確!

皆是

問題 2 5 / 5 分

目前CFA 考慮的 Fintech 範圍不包含哪項?

data analytics

金融科技使得金融服務具有	問題 5	5/5分	證券市場線	正確答案	HI 95 00
效率性 普及性	5/5分 「以人爲本的可信任 AI! 是爲了	機器人理專主要交易何種標的資	問題 12	期貨	問題 20 5 / 5 分
晋及性 正確!	回應 AI 預測可能造成某些特定		同題 12 5 / 5 分	股票	5/5分 物聯網在保險上的應用流程不包
皆是	的風險的誤判風險,具體作法包		假設投資組合 A 和 B 有相同的		括
	括:	正確!	平均報酬,相同的報酬標準差,		使用感測器
問題 2	謹慎開發或使用 AI 這類強大的	ETF	但投資組合 A 相較於投資組合 B	問題 16	大數據分析
5 / 5 分	工具以避免偏誤		有較低的貝塔值 (beta)。以夏普	5 / 5 分	風險評估
目前 CFA 考慮的 Fintech 範圍不	將風險就使用場合、可能造成的	問題 9	比例 (Sharpe ratio) 而言,投資	ETF 的風險包括	正確!
包含哪項?	損害,以及損害發生的機率等做		組合 A 的表現:	交易對手	理賠
data analytics	分級	以下那一項不是現行機器人理專	優於投資組合 B 的表現	税務	
robo advisor 正確!	聚焦高度風險的監理,例如信用 風險等,以避免過度監管	無面對面服務	正確! 相同於投資組合 B 的表現	正確! 皆是	外匯遠期契約可以視為一種線 性的商品
crowd funding	風 所守,以避 光 迎 及 监 官 正確!	正確!	有同於役員組合 B 的表現 劣於投資組合 B 的表現	省定	正確!
crowd funding	业难: 以上皆是	近~~ : 低波動	为	問題 17	正確:
問題 3		缺乏客製化	X WITT YOUNG	5/5分	錯誤
5 / 5 分	問題 6		問題 13	衡量期貨 ETF 績效的方式有	
以下哪些屬於另類資料 (alterna-	0 / 5 分	問題 10	5 / 5 分	效率性 (efficiency)	問題 2
tive data),與傳統金融的結構化	平台經濟模式的目標是?	0 / 5 分	ETF 具有以下哪些特質?	交易性 (tradability)	0 / 5 分
資料不同?	正確答案	機器人理專提供的資產配置是	股票	適配性 (fit)	理論上股指期貨價格應比現貨價
社群留言	金融生態圈	您已回答	基金	正確!	格高
衛星影像	您已回答	静態的	正確!	皆可	正確答案
大氣微粒子	數位轉型	正確答案	皆有		正確
正確!	跨城人才培養	動態的		問題 18	您已回答
以上皆是	AI 技術進步	高波動	問題 14	0/5分	錯误
問題 4	問題 7	費用率高	5 / 5 分 目前世界最大 AUM 的 ETF 是?	若是反向兩倍 ETF 所連結的指	問題 3
回題 4 5 / 5 分	5/5分	問題 11	正確!	数 第一 大工版 10 正 唯合 系 -4-20 您已回答	回題 3 5 / 5 分
'	6/57 機器人理專屬於金融六大功能的		SPY	2	金融衍生品只有歐式買權與賣權
析較爲困難?	哪一項?	在每個風險下找出最佳的投資組	VOO	問題 19	兩種形式
數據量大	正確!	合, 這些投資組合預期風險與預	SSO	5/5分	正確
複雜度高	投資管理	期報酬的點集合可畫出的曲線是		微保險的特色包括	正確!
資料清洗不易	籌資	無異曲線	問題 15	低保險給付	錯誤
正確!	支付	資本市場線	0 / 5 分	快速理賠	
以上皆是		正確!	槓反型 ETF 以操作哪種資產為	正確!	問題 4
	問題 8	效率前緣	主?	皆是	5 / 5 分
選擇權市場與債券市場可以互相		非線性	以下何種數學模型適合股價	(probability measure) 之下	Black-Scholes option pricing the
套利	IMF	非線性 皆可	布朗運動 (Brownian motion)	正確!	ory 中哪個量最常用來衡量選擇
套利 正確!	IMF 您已回答	皆可	布朗運動 (Brownian motion) 正確!	正確! 風險中立機率測度 (Risk-neutral	ory 中哪個量最常用來衡量選擇權的風險
套利 正確! 正確	IMF	皆可 問題 13	布朗運動 (Brownian motion) 正確! 幾何布朗運動 (Geometric Brow-	正確! 風險中立機率測度 (Risk-neutral probability measure)	ory 中哪個量最常用來衡量選擇權的風險 嚴約價 (Strike price)
套利 正確!	IMF 您已回答	皆可 問題 13 5/5分	布朗達動 (Brownian motion) 正確! 幾何布朗達動 (Geometric Brownian motion)	正確! 風險中立機率測度 (Risk-neutral	ory 中哪個量最常用來衡量選擇權的風險 嚴約價 (Strike price)
套利 正確! 正確	IMF 您已回答 WEF	皆可 問題 13	布朗運動 (Brownian motion) 正確! 幾何布朗運動 (Geometric Brow-	正確! 風險中立機率測度 (Risk-neutral probability measure) 歷史機率測度 (Historical proba-	ory 中哪個量最常用來衡量選擇 權的風險 嚴約價 (Strike price) 到期日 (Expiration date)
套利 正確! 錯誤	IMF 您已回答 WEF 問題 9 5/5分	皆可 問題 13 5/5分 哪種契約規範了買方有權利,但	布朗達動 (Brownian motion) 正確! 幾何布朗達動 (Geometric Brownian motion)	正確! 風險中立機率測度 (Risk-neutral probability measure) 歷史機率測度 (Historical proba- bility measure)	ory 中哪個量最常用來衡量選擇 權的風險 履約價 (Strike price) 到期日 (Expiration date) 正確!
套利 正確! 錯误 問題 5	IMF 您已回答 WEF 問題 9 5/5分 期貨採取哪種交易方式以規避違	皆可 問題 13 5/5分 哪種契約規範了買方有權利,但 非義務,可以在某國定的到期日	布朗運動 (Brownian motion) 正確! 幾何布朗運動 (Geometric Brownian motion) Poisson processes	正確! 風險中立機率測度 (Risk-neutral probability measure) 歷史機率測度 (Historical proba- bility measure)	ory 中哪個量最常用來衡量選擇 權的風險 履約價 (Strike price) 到期日 (Expiration date) 正確!
套利 正確! 錯误 問題 5 5/5分	IMF 您已回答 WEF 問題 9 5/5分 期貨採取哪種交易方式以規避違	皆可 問題 13 5/5分 哪種契約規範了買方有權利,但 非義務,可以在某固定的到期日 (maturity, expiration date) ,以	布朗達動 (Brownian motion) 正確! 幾何布朗達動 (Geometric Brownian motion) Poisson processes	正確! 風險中立機率測度 (Risk-neutral probability measure) 歷史機率測度 (Historical proba- bility measure) 皆可 問題 19	ory 中哪個量最常用來衡量選擇 權的風險 履約價 (Strike price) 到期日 (Expiration date) 正確! 波動率 (Volatility)
套利 正確! 話談 問題 5 5/5分 二元樹模型是離散時間下的選擇 權定價模型	IMF 您已回答 WEF 問題 9 5 / 5 分 期貸採取哪種交易方式以規避違 約風險 保證金制度 每日結算	皆可 問題 13 5/5分 哪種契約規範了買方有權利,但 非義務,可以在某固定的到期日 (maturity, expiration date),以 一個預先決定好了的履約價格, 來買入標的資產 正確!	布朗達動 (Brownian motion) 正確! 幾何布朗達動 (Geometric Brownian motion) Poisson processes 問題 17 0/5分 風險中立評價法主要是基於哪個 假設	正確! 風險中立機率測度 (Risk-neutral probability measure) 歷史機率測度 (Historical proba- bility measure) 皆可 問題 19 5/5分	ory 中哪個量最常用來衡量選擇 權的風險 履約價 (Strike price) 到期日 (Expiration date) 正確! 波動率 (Volatility) 問題 21 0/10 分 按單期二元定價模型,若期初股
套利 正確! 正確 錯談 問題 5 5/5分 二元樹模型是離散時間下的選擇 權定價模型 正確!	IMF 您已回答 WEF 問題 9 5/5分 期貨採取哪種交易方式以規避違 約風險 保證金制度 每日結算 正確!	皆可 問題 13 5/5分 哪種契約規範了買方有權利,但 非義務,可以在某固定的到期日 (maturity, expiration date),以 一個預先決定好了的履約價格, 來買入標的資產 正確! 買權	布朗運動 (Brownian motion) 正確! 幾何布朗運動 (Geometric Brownian motion) Poisson processes 問題 17 0/5分 風險中立評價法主要是基於哪個 假設 您已回答	正確! 風險中立機率測度 (Risk-neutral probability measure) 歷史機率測度 (Historical proba- bility measure) 皆可 問題 19 5/5分 最類似於 Black-Scholes pricing PDE 是哪一種	ory 中哪個量最常用來衡量選擇 權的風險 履約價 (Strike price) 到期日 (Expiration date) 正確! 波動率 (Volatility) 問題 21 0 / 10 分 接單期二元定價模型,若期初股 價為 1 元,一季内上漲與下跌幅
套利 正確! 話談 問題 5 5/5分 二元樹模型是離散時間下的選擇 權定價模型	IMF 您已回答 WEF 問題 9 5 / 5 分 期貸採取哪種交易方式以規避違 約風險 保證金制度 每日結算	皆可 問題 13 5/5分 哪種契約規範了買方有權利,但 非義務,可以在某固定的到期日 (maturity, expiration date),以 一個預先決定好了的履約價格, 來買入標的資產 正確! 買權 賣權	布朗運動 (Brownian motion) 正確! 幾何布朗運動 (Geometric Brownian motion) Poisson processes 問題 17 0/5分 風險中立評價法主要是基於哪個假設 您已回答 最佳複製	正確! 風險中立機率測度 (Risk-neutral probability measure) 歴史機率測度 (Historical probability measure) 皆可 問題 19 5/5分 最類似於 Black-Scholes pricing PDE 是哪一種 正確!	ory 中哪個量最常用來衡量選擇 權的風險 履約價 (Strike price) 到期日 (Expiration date) 正確! 波動率 (Volatility) 問題 21 0 / 10 分 按單期二元定價模型,若期初股 價為 1 元,一季內上深與下跌幅 度皆為 10
套利 正確! 正確 錯談 問題 5 5/5分 二元樹模型是離散時間下的選擇 權定價模型 正確!	IMF 您已回答 WEF 問題 9 5/5分 期貨採取哪種交易方式以規避違 約風險 保證金制度 每日結算 正確! 以上皆是	皆可 問題 13 5/5分 哪種契約規範了買方有權利,但 非義務,可以在某固定的到期日 (maturity, expiration date),以 一個預先決定好了的履約價格, 來買入標的資產 正確! 買權	布朗運動 (Brownian motion) 正確! 幾何布朗運動 (Geometric Brownian motion) Poisson processes 問題 17 0 / 5 分 風險中立評價法主要是基於哪個假設 您已回答 最佳複製 正確答案	正確! 風險中立機率測度 (Risk-neutral probability measure) 歷史機率測度 (Historical probability measure) 皆可 問題 19 5/5分 最類似於 Black-Scholes pricing PDE 是哪一種 正確! 熱傳導方程式 (heat equation)	ory 中哪個量最常用來衡量選擇權的風險 履約價 (Strike price) 到期日 (Expiration date) 正確! 波動率 (Volatility) 問題 21 0 / 10 分 按單期二元定價模型,若期初股 價為 1 元,一季內上源與下跌幅 度皆為 10 您已回答
套利 正確! 正確 錯談 問題 5 / 5 分 二元樹模型是離散時間下的選擇 程定確! 正確 錯誤	IMF 您已回答 WEF 問題 9 5/5分 期貨採取哪種交易方式以規避違 約風險 保證金制度 每日結算 正確! 以上皆是	皆可 問題 13 5/5分 哪種契約規範了買方有權利,但 非義務,可以在某固定的到期日 (maturity, expiration date) ,以 一個預先決定好了的履約價格, 來買入標的資產 正確! 買權 費權	布朗運動 (Brownian motion) 正確! 幾何布朗運動 (Geometric Brownian motion) Poisson processes 問題 17 0 / 5 分 風險中立評價法主要是基於哪個 假設 您已回答 最佳複製 正確答案 完美複製	正確! 風險中立機率測度 (Risk-neutral probability measure) 歴史機率測度 (Historical probability measure) 皆可 問題 19 5/5分 最類似於 Black-Scholes pricing PDE 是哪一種 正確! 熱傳導方程式 (heat equation) 歴史機率測度 (Historical proba-	ory 中哪個量最常用來衡量選擇權的風險 履約價 (Strike price) 到期日 (Expiration date) 正確! 波動率 (Volatility) 問題 21 0 / 10 分 按單期二元定價模型,若期初股 價為 1 元,一季內上源與下跌幅 度皆為 10 您已回答 1.11
套利 正確! 正正確 錯凝 問題 5 5/5分 二元樹模型是離散時間下的選擇 權定價模型 正確! 話談 問題 6 5/5分	IMF 您已回答 WEF 問題 9 5/5分 期貨採取哪種交易方式以規避違 約風險 保證金制度 每日結算 正確! 以上皆是 問題 10 5/5分	皆可 問題 13 5/5分 哪種契約規範了買方有權利,但 非義務,可以在某固定的到期日 (maturity, expiration date) ,以 一個預先決定好了的履約價格, 來買入標的資產 正確! 買權 費權 期貨	布朗運動 (Brownian motion) 正確! 幾何布朗運動 (Geometric Brownian motion) Poisson processes 問題 17 0 / 5 分 風險中立評價法主要是基於哪個假設 您已回答 最佳複製 正確答案	正確! 風險中立機率測度 (Risk-neutral probability measure) 歷史機率測度 (Historical probability measure) 皆可 問題 19 5/5分 最類似於 Black-Scholes pricing PDE 是哪一種 正確! 熱傳導方程式 (heat equation) 歷史機率測度 (Historical probability measure)	ory 中哪個量最常用來衡量選擇權的風險 履約價 (Strike price) 到期日 (Expiration date) 正確! 波動率 (Volatility) 問題 21 0 / 10 分 按單期二元定價模型,若期初股 價為 1 元,一季內上源與下跌幅 度皆為 10 您已回答 1.11 正確答案
套利 正確! 正確 錯凝 問題 5 5/5分 二元樹模型是離散時間下的選擇權正確! 正確 錯誤 問題 6 5/5分 何者是金融工程領域中所荣獲的	IMF 您已回答 WEF 問題 9 5/5分 期貨採取哪種交易方式以規避違 約風險 保證金制度 每日結算 正確! 以上皆是 問題 10 5/5分 期貨市場不具備哪一項功能	皆可 問題 13 5/5分 哪種契約規範了買方有權利,但 非義務,可以在某固定的到期日 (maturity, expiration date) ,以 一個預先決定好了的嚴約價格, 來買入標的資產 正確! 買權 費權 期貨	布朗運動 (Brownian motion) 正確! 幾何布朗運動 (Geometric Brownian motion) Poisson processes 問題 17 0 / 5 分 風險中立評價法主要是基於哪個 假設 您已回答 最佳複製 正確答案 完美複製 最小變異	正確! 風險中立機率測度 (Risk-neutral probability measure) 歴史機率測度 (Historical probability measure) 皆可 問題 19 5/5分 最類似於 Black-Scholes pricing PDE 是哪一種 正確! 熱傳導方程式 (heat equation) 歴史機率測度 (Historical proba-	ory 中哪個量最常用來衡量選擇權的風險 履約價 (Strike price) 到期日 (Expiration date) 正確! 波動率 (Volatility) 問題 21 0 / 10 分 按單期二元定價模型,若期初股 價為 1 元,一季內上源與下跌幅 度皆為 10 您已回答 1.11
套利 正確! 正確 錯凝 問題 5 5/5分 一元樹模型是離散時間下的選擇 權正確! 正確 錯誤 問題 6 5/5分 何者是金融工程領域中所荣獲的 諾貝爾獎	IMF 您已回答 WEF 問題 9 5/5分 期貨採取哪種交易方式以規避違 約風險 保證金制度 每日結算 正確! 以上皆是 問題 10 5/5分 期貨市場不具備哪一項功能 极機	皆可 問題 13 5/5分 哪種契約規範了買方有權利,但 非義務,可以在某固定的到期日 (maturity, expiration date) ,以 一個預先決定好了的履約價格, 來買入標的資產 正確! 買權 實權 期貨 問題 14 0/5分 選擇權契約的賣方在取得了權利	布朗運動 (Brownian motion) 正確! 幾何布朗運動 (Geometric Brownian motion) Poisson processes 問題 17 0 / 5 分 風險中立評價法主要是基於哪個 假設 您已回答 最佳複製 正確答案 完美複製 最小變異	正確! 風險中立機率測度 (Risk-neutral probability measure) 歷史機率測度 (Historical probability measure) 皆可 問題 19 5/5分 最類似於 Black-Scholes pricing PDE 是哪一種 正確! 熱傳導方程式 (heat equation) 歷史機率測度 (Historical probability measure) 皆可	ory 中哪個量最常用來衡量選擇權的風險 履約價 (Strike price) 到期日 (Expiration date) 正確! 波動率 (Volatility) 問題 21 0 / 10 分 按單期二元定價模型,若期初股 價為 1 元,一季內上源與下跌幅 度皆為 10 您已回答 1.11 正確答案
套利 正確! 正確 錯凝 問題 5 5/5分 二元樹模型是離散時間下的選擇權正確! 正確 錯誤 問題 6 5/5分 何者是金融工程領域中所荣獲的	IMF 您已回答 WEF 問題 9 5/5分 期貨採取哪種交易方式以規避違 約風險 保證金制度 每日結算 正確! 以上皆是 問題 10 5/5分 期貨市場不具備哪一項功能	皆可 問題 13 5/5分 哪種契約規範了買方有權利,但 非義務,可以在某固定的到期日 (maturity, expiration date) ,以 一個預先決定好了的嚴約價格, 來買入標的資產 正確! 買權 費權 期貨	布朗運動 (Brownian motion) 正確! 幾何布朗運動 (Geometric Brownian motion) Poisson processes 問題 17 0 / 5 分 風險中立評價法主要是基於哪個 假設 您已回答 最佳複製 正確答案 完美複製 最小變異	正確! 風險中立機率測度 (Risk-neutral probability measure) 歷史機率測度 (Historical probability measure) 皆可 問題 19 5/5分 最類似於 Black-Scholes pricing PDE 是哪一種 正確! 熱傳導方程式 (heat equation) 歷史機率測度 (Historical probability measure) 皆可	ory 中哪個量最常用來衡量選擇權的風險 履約價 (Strike price) 到期日 (Expiration date) 正確! 波動率 (Volatility) 問題 21 0 / 10 分 按單期二元定價模型,若期初股 價為 1 元,一季內上源與下跌幅 度皆為 10 您已回答 1.11 正確答案
套利 正確! 正正確 錯談 問題 5 5/5分 二元樹模型是離散時間下的選擇權正確! 正確 錯談 問題 6 5/5分 何者是金融工程領域中所荣獲的 諾貝爾獎	IMF 您已回答 WEF 問題 9 5/5分 期貨採取哪種交易方式以規避違 約風險 保證金制度 每日結算 正確! 以上皆是 問題 10 5/5分 期貨市場不具備哪一項功能 投機	皆可 問題 13 5/5分 哪種契約規範了買方有權利,但 非義務,可以在某固定的到期日 (maturity, expiration date) ,以 一個預先決定好了的履約價格, 來買入標的資產 正確! 買權 實權 期貨 問題 14 0/5分 選擇權契約的賣方在取得了權利 金之後,如何支付未來可能的報	布朗運動 (Brownian motion) 正確! 幾何布朗運動 (Geometric Brownian motion) Poisson processes 問題 17 0 / 5 分 風險中立評價法主要是基於哪個 假設 您已回答 最佳複製 正確答案 完美複製 最小變異 問題 18 5 / 5 分	正確! 風險中立機率測度 (Risk-neutral probability measure) 歷史機率測度 (Historical probability measure) 皆可 問題 19 5/5分 最類似於 Black-Scholes pricing PDE 是哪一種 正確! 熱傳導方程式 (heat equation) 歷史機率測度 (Historical probability measure) 皆可	ory 中哪個量最常用來衡量選擇權的風險 履約價 (Strike price) 到期日 (Expiration date) 正確! 波動率 (Volatility) 問題 21 0 / 10 分 按單期二元定價模型,若期初股 價為 1 元,一季內上源與下跌幅 度皆為 10 您已回答 1.11 正確答案
套利 正確! 正正確 錯談 問題 5 5/5分 二元樹模型是離散時間下的選擇權正確! 正正確 錯談 問題 6 5/5分 何者是金融工程領域中所荣獲的 誤賣組合理論 選權權定價	IMF 您已回答 WEF 問題 9 5/5分 期貨採取哪種交易方式以規避違 約風險 保證金制度 每日結算 正確! 以上皆是 問題 10 5/5分 期貨市場不具備哪一項功能 投機 正確!	皆可 問題 13 5/5分 哪種契約規範了買方有權利,但 非義務,可以在某固定的到期日 (maturity, expiration date) ,以 一個預先決定好了的履約價格, 來買入標的資產 正確! 買權 實權 期貨 問題 14 0/5分 選擇權契約的賣方在取得了權利 金之後,如何支付未來可能的報 酬問題,屬於哪類	布朗運動 (Brownian motion) 正確! 幾何布朗運動 (Geometric Brownian motion) Poisson processes 問題 17 0 / 5 分 風險中立評價法主要是基於哪個 假設 您已回答 最佳複製 正確答案 完美複製 最小變異 問題 18 5 / 5 分	正確! 風險中立機率測度 (Risk-neutral probability measure) 歷史機率測度 (Historical probability measure) 皆可 問題 19 5/5分 最類似於 Black-Scholes pricing PDE 是哪一種 正確! 熱傳導方程式 (heat equation) 歷史機率測度 (Historical probability measure) 皆可	ory 中哪個量最常用來衡量選擇權的風險 履約價 (Strike price) 到期日 (Expiration date) 正確! 波動率 (Volatility) 問題 21 0 / 10 分 按單期二元定價模型,若期初股 價為 1 元,一季內上源與下跌幅 度皆為 10 您已回答 1.11 正確答案
套利 正確! 正正確 錯談 問題 5 5/5分 一元樹模型是離散時間下的選擇 權正確! 話錄 問題 6 5/5分 何者是金融工程領域中所榮獲的 證模權之價 選權權之價 正 证!	IMF 您已回答 WEF 問題 9 5/5分 期貨採取哪種交易方式以規避違 約風險 保證金制度 每日結算 正確! 以上皆是 問題 10 5/5分 期貨市場不具備哪一項功能 投機 正確!	皆可 問題 13 5/5分 哪種契約規範了買方有權利,但 非義務,可以在某固定的到期日 (maturity, expiration date) ,以 一個預先決定好了的履約價格, 來買入標的資產 正確! 買權 費權 期貨 問題 14 0/5分 選擇權契約的賣方在取得了權利 金之後,如何支付未來可能的報 酬問題,屬於哪類 您已回答 定價 正確答案	布朗運動 (Brownian motion) 正確! 幾何布朗運動 (Geometric Brownian motion) Poisson processes 問題 17 0 / 5 分 風險中立評價法主要是基於哪個 假設 您已回答 最佳複製 正確答案 完美複製 最小變異 問題 18 5 / 5 分	正確! 風險中立機率測度 (Risk-neutral probability measure) 歷史機率測度 (Historical probability measure) 皆可 問題 19 5/5分 最類似於 Black-Scholes pricing PDE 是哪一種 正確! 熱傳導方程式 (heat equation) 歷史機率測度 (Historical probability measure) 皆可	ory 中哪個量最常用來衡量選擇權的風險 履約價 (Strike price) 到期日 (Expiration date) 正確! 波動率 (Volatility) 問題 21 0 / 10 分 按單期二元定價模型,若期初股 價為 1 元,一季內上源與下跌幅 度皆為 10 您已回答 1.11 正確答案
套利 正確! E正確! 問題 5 5/5分 一元樹模型是離散時間下的選擇 權正確! 問題 6 5/5分 何者是重點工程領域中所榮獲的 證權權之價 選權權之價 正以上皆是	IMF 您已回答 WEF 問題 9 5/5分 期貨採取哪種交易方式以規避違 約風險 保證金制度 每日結算 正確! 以上皆是 問題 10 5/5分 期貨市場不具備哪一項功能 投機 正確! 程定金融市場 避險	皆可 問題 13 5/5分 哪種契約規範了買方有權利,但 非義務,可以在某固定的到期日 (maturity, expiration date) ,以 一個預先決定好了的履約價格, 來買入標的資產 正確! 買權 費權 期貨 問題 14 0/5分 選擇權契約的賣方在取得了權利 金之後,如何支付未來可能的報 酬問題,屬於哪類 您已回答 定價 正確答案 避險	布朗運動 (Brownian motion) 正確! 幾何布朗運動 (Geometric Brownian motion) Poisson processes 問題 17 0 / 5 分 風險中立評價法主要是基於哪個 假設 您已回答 最佳複製 正確答案 完美複製 最小變異 問題 18 5 / 5 分	正確! 風險中立機率測度 (Risk-neutral probability measure) 歷史機率測度 (Historical probability measure) 皆可 問題 19 5/5分 最類似於 Black-Scholes pricing PDE 是哪一種 正確! 熱傳導方程式 (heat equation) 歷史機率測度 (Historical probability measure) 皆可	ory 中哪個量最常用來衡量選擇權的風險 履約價 (Strike price) 到期日 (Expiration date) 正確! 波動率 (Volatility) 問題 21 0 / 10 分 按單期二元定價模型,若期初股 價為 1 元,一季內上源與下跌幅 度皆為 10 您已回答 1.11 正確答案
套利 正確! E正確 錯凝 問題 5 5/5分 一程之權數時間下的選擇 權正確! 避難 6 5/5分 會對 6 5/5分 會對 6 方/5分 融工程領域中所榮獲的 護權權! 近確! 避確! 避难之價 遲確! 避難 2 以置權權!	IMF 您已回答 WEF 問題 9 5/5分 期貨採取哪種交易方式以規避違 約風險 保證金制度 每日結算 正確! 以上皆是 問題 10 5/5分 期貨市場不具備哪一項功能 投機 正確! 程定金融市場 避險	皆可 問題 13 5/5分 哪種契約規範了買方有權利,但 非義務,可以在某固定的到期日 (maturity, expiration date) ,以 一個預先決定好了的履約價格, 來買入標的資產 正確! 買權 費權 期貨 問題 14 0/5分 選擇權契約的賣方在取得了權利 金之後,如何支付未來可能的報 酬問題,屬於哪類 您已回答 定價 正確答案 避險	布朗運動 (Brownian motion) 正確! 幾何布朗運動 (Geometric Brownian motion) Poisson processes 問題 17 0 / 5 分 風險中立評價法主要是基於哪個 假設 您已回答 最佳複製 正確答案 完美複製 最小變異 問題 18 5 / 5 分	正確! 風險中立機率測度 (Risk-neutral probability measure) 歷史機率測度 (Historical probability measure) 皆可 問題 19 5/5分 最類似於 Black-Scholes pricing PDE 是哪一種 正確! 熱傳導方程式 (heat equation) 歷史機率測度 (Historical probability measure) 皆可	ory 中哪個量最常用來衡量選擇權的風險 履約價 (Strike price) 到期日 (Expiration date) 正確! 波動率 (Volatility) 問題 21 0 / 10 分 按單期二元定價模型,若期初股 價為 1 元,一季內上源與下跌幅 度皆為 10 您已回答 1.11 正確答案
套利 正確! 問題 5 5/5分 一元樹模型是離散時間下的選擇 權正確! 問題 6 5/5分 會計 1 6 6 6 7/5分 會對 1 6 6 7 7 8 8 8 8 8 8 8 8 8 8 8 8 8 8 8 8	IMF 您已回答 WEF 問題 9 5/5分 期貸採取哪種交易方式以規避違 約風險 保證金制度 每日結算 正確! 以上皆是 問題 10 5/5分 期貨輸來具備哪一項功能 投機 正確! 穩定金融市場 避險 問題 11 5/5分 利用哪種合約可以轉換公司間的 資產或負債	皆可 問題 13 5/5分 哪種契約規範了買方有權利,但 非義務,可以在某固定的到期日 (maturity, expiration date) ,以 一個預先決定好了的履約價格, 來買入標的資產 正確! 買權 費權 期貨 問題 14 0/5分 選擇權契約的賣方在取得了權利 金之後,如何支付未來可能的報 酬問題,屬於哪類 您已回答 定價 正確答案 避險	布朗運動 (Brownian motion) 正確! 幾何布朗運動 (Geometric Brownian motion) Poisson processes 問題 17 0 / 5 分 風險中立評價法主要是基於哪個 假設 您已回答 最佳複製 正確答案 完美複製 最小變異 問題 18 5 / 5 分	正確! 風險中立機率測度 (Risk-neutral probability measure) 歷史機率測度 (Historical probability measure) 皆可 問題 19 5/5分 最類似於 Black-Scholes pricing PDE 是哪一種 正確! 熱傳導方程式 (heat equation) 歷史機率測度 (Historical probability measure) 皆可	ory 中哪個量最常用來衡量選擇權的風險 履約價 (Strike price) 到期日 (Expiration date) 正確! 波動率 (Volatility) 問題 21 0 / 10 分 按單期二元定價模型,若期初股 價為 1 元,一季內上源與下跌幅 度皆為 10 您已回答 1.11 正確答案
套利 正確! 正正確! 問題 5 5/5分 一般型是離散時間下的選擇 權定確! 正確 錯疑 問題 6 6/5分 何者員額会理領域中所榮獲的 護權權是 定以 問題 7 分分全融 正以 問題 7 分分 響 の の の の の の の の の の の の の の の の の	IMF 您已回答 WEF 問題 9 5/5分 期貨採取哪種交易方式以規避違 約風險 保證金制度 每日結算 正確! 以上皆是 問題 10 5/5分 期貨橋哪一項功能 投機 正確! 穩定金融市場 避險 問題 11 5/5分 利用哪種合約可以轉換公司問的 資產或負債 正確!	皆可 問題 13 5/5分 哪種契約規範了買方有權利,但 非義務,可以在某固定的到期日 (maturity, expiration date) ,以 一個預先決定好了的履約價格, 來買入標的資產 正確! 買權 費權 期貨 問題 14 0/5分 選擇權契約的賣方在取得了權利 金之後,如何支付未來可能的報 酬問題,屬於哪類 您已回答 定價 正確答案 避險 套利	布朗運動 (Brownian motion) 正確! 幾何布朗運動 (Geometric Brownian motion) Poisson processes 問題 17 0 / 5 分 風險中立評價法主要是基於哪個 假設 您已回答 最佳複製 正確答案 完美複製 最小變異 問題 18 5 / 5 分	正確! 風險中立機率測度 (Risk-neutral probability measure) 歷史機率測度 (Historical probability measure) 皆可 問題 19 5/5分 最類似於 Black-Scholes pricing PDE 是哪一種 正確! 熱傳導方程式 (heat equation) 歷史機率測度 (Historical probability measure) 皆可	ory 中哪個量最常用來衡量選擇權的風險 履約價 (Strike price) 到期日 (Expiration date) 正確! 波動率 (Volatility) 問題 21 0 / 10 分 按單期二元定價模型,若期初股 價為 1 元,一季內上源與下跌幅 度皆為 10 您已回答 1.11 正確答案
套利 正確! 正確 對 5 / 5 分 一元樹模型是離散時間下的選擇 權 正確 對 6 6 5 / 5 分 何者與 4 與 4 與 4 與 4 與 4 與 4 與 4 與 4 與 4 與 4	IMF 您已回答 WEF 問題 9 5/5分 期貸採取哪種交易方式以規避違 約風險 保證金制度 每日結算 正確! 以上皆是 問題 10 5/5分 期貨權 概定金融市場 避險 問題 11 5/5分 利用哪種合約可以轉換公司問的 資產或負債 正確! 交換(swap)	皆可 問題 13 5/5分 哪種契約規範丁買方有權利,但 非義務,可以在某固定的到期日 (maturity, expiration date) ,以 一個預先決定好了的履約價格, 來買入標的資產 正確! 買權 費權 期貨 問題 14 0/5分 選擇權契約的賣方在取得了權利 金之後,如何支付未來可能的報 關問題,屬於哪類 您已回答 定價 正確答案 避險 套利 問題 15 5/5分	布朗運動 (Brownian motion) 正確! 幾何布朗運動 (Geometric Brownian motion) Poisson processes 問題 17 0 / 5 分 風險中立評價法主要是基於哪個 假設 您已回答 最佳複製 正確答案 完美複製 最小變異 問題 18 5 / 5 分	正確! 風險中立機率測度 (Risk-neutral probability measure) 歷史機率測度 (Historical probability measure) 皆可 問題 19 5/5分 最類似於 Black-Scholes pricing PDE 是哪一種 正確! 熱傳導方程式 (heat equation) 歷史機率測度 (Historical probability measure) 皆可	ory 中哪個量最常用來衡量選擇權的風險 履約價 (Strike price) 到期日 (Expiration date) 正確! 波動率 (Volatility) 問題 21 0 / 10 分 按單期二元定價模型,若期初股 價為 1 元,一季內上源與下跌幅 度皆為 10 您已回答 1.11 正確答案
套利 正確! 正確 對	IMF 您已回答 WEF 問題 9 5/5分 期貨採取哪種交易方式以規避違 約風險 保證金制度 每日結算 正確! 以上皆是 問題 10 5/5分 期貨商場不具備哪一項功能 投機 正確! 穩定金融市場 避險 問題 11 5/5分 利用哪種合約可以轉換公司間的 資產或負債 正確! 交換 (swap) 遠期 (forward)	皆可 問題 13 5/5分 哪種契約規範了買方有權利,但 非義務,可以在某固定的到期日 (maturity, expiration date) ,以 一個預先決定好了的履約價格, 來買入標的資產 正確! 買權 費權 期貨 問題 14 0/5分 選擇權契約的賣方在取得了權利 金之後,如何支付未來可能的報 問題 % 屬於哪類 您已回答 定價 正確答案 避險 套利 問題 15 5/5分 何者交易行為造成門崩	布朗運動 (Brownian motion) 正確! 幾何布朗運動 (Geometric Brownian motion) Poisson processes 問題 17 0 / 5 分 風險中立評價法主要是基於哪個 假設 您已回答 最佳複製 正確答案 完美複製 最小變異 問題 18 5 / 5 分	正確! 風險中立機率測度 (Risk-neutral probability measure) 歷史機率測度 (Historical probability measure) 皆可 問題 19 5/5分 最類似於 Black-Scholes pricing PDE 是哪一種 正確! 熱傳導方程式 (heat equation) 歷史機率測度 (Historical probability measure) 皆可	ory 中哪個量最常用來衡量選擇權的風險 履約價 (Strike price) 到期日 (Expiration date) 正確! 波動率 (Volatility) 問題 21 0 / 10 分 按單期二元定價模型,若期初股 價為 1 元,一季內上源與下跌幅 度皆為 10 您已回答 1.11 正確答案
套利 正確! E正確! 問題 5 5/5分 一元樹模型是離散時間下的選擇 權正確! 問題 6 5/5分 會計 2 6 6 7 7 8 8 8 8 8 8 8 8 8 8 8 8 8 8 8 8	IMF 您已回答 WEF 問題 9 5/5分 期貸採取哪種交易方式以規避違 約風險 保證金制度 每日結算 正確! 以上皆是 問題 10 5/5分 期貨權 概定金融市場 避險 問題 11 5/5分 利用哪種合約可以轉換公司問的 資產或負債 正確! 交換(swap)	皆可 問題 13 5/5分 哪種契約規範丁買方有權利,但 非義務,可以在某固定的到期日 (maturity, expiration date) ,以 一個預先決定好了的履約價格, 來買入標的資產 正確! 買權 費權 期貨 問題 14 0/5分 選擇權契約的賣方在取得了權利 金之後,如何支付未來可能的報 問題 經 學問題 屬於哪類 您已回答 定價 正確答案 避險 套利 問題 15 5/5分 何者交易行為造成門崩	布朗運動 (Brownian motion) 正確! 幾何布朗運動 (Geometric Brownian motion) Poisson processes 問題 17 0 / 5 分 風險中立評價法主要是基於哪個 假設 您已回答 最佳複製 正確答案 完美複製 最小變異 問題 18 5 / 5 分	正確! 風險中立機率測度 (Risk-neutral probability measure) 歷史機率測度 (Historical probability measure) 皆可 問題 19 5/5分 最類似於 Black-Scholes pricing PDE 是哪一種 正確! 熱傳導方程式 (heat equation) 歷史機率測度 (Historical probability measure) 皆可	ory 中哪個量最常用來衡量選擇權的風險 履約價 (Strike price) 到期日 (Expiration date) 正確! 波動率 (Volatility) 問題 21 0 / 10 分 按單期二元定價模型,若期初股 價為 1 元,一季內上源與下跌幅 度皆為 10 您已回答 1.11 正確答案
套利 正確! 正確 對	IMF 您已回答 WEF 問題 9 5/5分 期貨採取哪種交易方式以規避違 約風險 保證金制度 每日結算 正確! 以上皆是 問題 10 5/5分 期貨商場不具備哪一項功能 投機 正確! 穩定金融市場 避險 問題 11 5/5分 利用哪種合約可以轉換公司間的 資產或負債 正確! 交換 (swap) 遠期 (forward)	皆可 問題 13 5/5分 哪種契約規範了買方有權利,但 非義務,可以在某固定的到期日 (maturity, expiration date) ,以 一個預先決定好了的履約價格, 來買入標的資產 正確! 買權 費權 期貨 問題 14 0/5分 選擇權契約的賣方在取得了權利 金之後,如何支付未來可能的報 問題 % 屬於哪類 您已回答 定價 正確答案 避險 套利 問題 15 5/5分 何者交易行為造成門崩	布朗運動 (Brownian motion) 正確! 幾何布朗運動 (Geometric Brownian motion) Poisson processes 問題 17 0 / 5 分 風險中立評價法主要是基於哪個 假設 您已回答 最佳複製 正確答案 完美複製 最小變異 問題 18 5 / 5 分	正確! 風險中立機率測度 (Risk-neutral probability measure) 歷史機率測度 (Historical probability measure) 皆可 問題 19 5/5分 最類似於 Black-Scholes pricing PDE 是哪一種 正確! 熱傳導方程式 (heat equation) 歷史機率測度 (Historical probability measure) 皆可	ory 中哪個量最常用來衡量選擇權的風險 履約價 (Strike price) 到期日 (Expiration date) 正確! 波動率 (Volatility) 問題 21 0 / 10 分 按單期二元定價模型,若期初股 價為 1 元,一季內上源與下跌幅 度皆為 10 您已回答 1.11 正確答案
套利 正確! E正確! 問題 5 5/5分 一元樹模型是離散時間下的選擇 權正確! 問題 6 5/5分 會計 2 6 6 7 7 8 8 8 8 8 8 8 8 8 8 8 8 8 8 8 8	IMF 您已回答 WEF 問題 9 5/5分 期貸採取哪種交易方式以規避違 約風險 保證金制度 每日結算 正確! 以上皆是 問題 10 5/5分 期貨市場不具備哪一項功能 投機 正確! 穩定金融市場 避險 問題 11 5/5分 利用哪種合約可以轉換公司間的 資產或負債 正確! 交換 (swap) 遠期 (forward) 期貨 (futures)	皆可 問題 13 5/5分 哪種契約規範丁買方有權利,但 非義務,可以在某國定的到期日 (maturity, expiration date) ,以 一個預先決定好了的履約價格, 來買入標的資產 正確! 買權 費權 期貨 問題 14 0/5分 選擇權契約的賣方在取得了權利 金之後,如何支付未來可能的報 問題 經歷 歷史 國際 歷史 國際 養利 問題 15 5/5分 何者交易行為造成門崩 養利 配對	布朗運動 (Brownian motion) 正確! 幾何布朗運動 (Geometric Brownian motion) Poisson processes 問題 17 0 / 5 分 風險中立評價法主要是基於哪個 假設 您已回答 最佳複製 正確答案 完美複製 最小變異 問題 18 5 / 5 分	正確! 風險中立機率測度 (Risk-neutral probability measure) 歷史機率測度 (Historical probability measure) 皆可 問題 19 5/5分 最類似於 Black-Scholes pricing PDE 是哪一種 正確! 熱傳導方程式 (heat equation) 歷史機率測度 (Historical probability measure) 皆可	ory 中哪個量最常用來衡量選擇權的風險 履約價 (Strike price) 到期日 (Expiration date) 正確! 波動率 (Volatility) 問題 21 0 / 10 分 按單期二元定價模型,若期初股 價為 1 元,一季內上源與下跌幅 度皆為 10 您已回答 1.11 正確答案
套利 正確! 正確 對	IMF 您已回答 WEF 問題 9 5/5分 期貨採取哪種交易方式以規避違 約風險 保證金制度 每日結算 正確! 以上皆是 問題 10 5/5分 期貨市場不具備哪一項功能 投機 正確! 穩定金融市場 避險 問題 11 5/5分 利用哪種合約可以轉換公司問的 資產或負債 正確! 交換 (swap) 遠期 (forward) 期貨 (futures)	皆可 問題 13 5/5分 哪種契約規範了買方有權利,但 非義務,可以在某國定的到期日 (maturity, expiration date) ,以 一個預先決定好了的履約價格, 來買入標的資產 正確! 買權 動貨 問題 14 0/5分 選擇權契約的賣方在取得了權利 金之後,如何支付未來可能的報 問題 26 一定價 正確答案 避險 套利 問題 15 5/5分 何者交易行為造成門 所養利 配對 正確!	布朗運動 (Brownian motion) 正確! 幾何布朗運動 (Geometric Brownian motion) Poisson processes 問題 17 0 / 5 分 風險中立評價法主要是基於哪個 假設 您已回答 最佳複製 正確答案 完美複製 最小變異 問題 18 5 / 5 分	正確! 風險中立機率測度 (Risk-neutral probability measure) 歷史機率測度 (Historical probability measure) 皆可 問題 19 5/5分 最類似於 Black-Scholes pricing PDE 是哪一種 正確! 熱傳導方程式 (heat equation) 歷史機率測度 (Historical probability measure) 皆可	ory 中哪個量最常用來衡量選擇權的風險 履約價 (Strike price) 到期日 (Expiration date) 正確! 波動率 (Volatility) 問題 21 0 / 10 分 按單期二元定價模型,若期初股 價為 1 元,一季內上源與下跌幅 度皆為 10 您已回答 1.11 正確答案
套利 正確! 正確 對 5 / 5 分 一元樹模型是離散時間下的選擇 權 正確 對 6 6 5 / 5 分 何者與愛難 對間 6 6 5 / 5 分 何者與獨 中所榮獲的 對 獲權 權 ! 以 選權權 ! 以 實 後 ② 以 實 後 ② 以 實 後 ② 以 對 多 以 對 多 以 對 多 以 對 多 以 對 多 以 對 多 以 對 多 以 對 多 以 對 多 以 對 多 以 對 多 以 對 多 以 對 多 以 對 多 以 對 多 以 對 多 以 對 以 對	IMF 您已回答 WEF 問題 9 5/5分 期貸採取哪種交易方式以規避違 的風險 保證金制度 每日結算 正確! 以上皆是 問題 10 5/5分 期貨相哪一項功能 被機 正確! 穩定金融市場 避險 問題 11 5/5分 利用哪種合約可以轉換公司間的 資產或負債 正確! 交換 (swap) 遠期 (forward) 期貨 (futures)	皆可 問題 13 5/5分 哪種契約規範了買方有權利,但 非義務,可以在某國定的到期日 (maturity, expiration date) ,以 一個預先決定好了的履約價格, 來買入標的資產 正確! 買權 動貨 問題 14 0/5分 選擇權契約的賣方在取得了權利 金之後,如何支付未來可能的報 問題 26 一定價 正確答案 避險 套利 問題 15 5/5分 何者交易行為造成門 所養利 配對 正確!	布朗運動 (Brownian motion) 正確! 幾何布朗運動 (Geometric Brownian motion) Poisson processes 問題 17 0 / 5 分 風險中立評價法主要是基於哪個 假設 您已回答 最佳複製 正確答案 完美複製 最小變異 問題 18 5 / 5 分	正確! 風險中立機率測度 (Risk-neutral probability measure) 歷史機率測度 (Historical probability measure) 皆可 問題 19 5/5分 最類似於 Black-Scholes pricing PDE 是哪一種 正確! 熱傳導方程式 (heat equation) 歷史機率測度 (Historical probability measure) 皆可	ory 中哪個量最常用來衡量選擇權的風險 履約價 (Strike price) 到期日 (Expiration date) 正確! 波動率 (Volatility) 問題 21 0 / 10 分 按單期二元定價模型,若期初股 價為 1 元,一季內上源與下跌幅 度皆為 10 您已回答 1.11 正確答案

正確答案

正確!

5/5分