

2018 年 10 月基金从业考试《证券投资基金基础知识》模考大赛试卷三

一、单项选择题(共 100 题，每题 1 分，共 100 分。下列选项中只有一项最符合题目要求。不选、错选均不得分)

第 1 题.对投资组合管理能力的评价包括哪三个部分?

- I 调控价格能力
- II 风险管理能力
- III 证券选择能力
- IV 时机选择能力

- A. I 、 II 、 III
- B. I 、 II 、 IV
- C. I 、 III 、 IV
- D. II 、 III 、 IV

答案 : D

第 2 题.下列对于沪港通的说法中，正确的是()。

- I 2015 年 4 月 10 日，中国证监会正式批复沪港通
- II 沪港通分为沪股通和港股通两个部分
- III 沪股通下的股票交易于 2014 年 11 月 17 日开始
- IV 沪港通的双向交易均以人民币作为结算单位

- A. I 、 II
- B. I 、 II 、 IV
- C. II 、 III 、 IV
- D. I 、 II 、 III 、 IV

答案 : C

第 3 题.在分析基金的持仓结构时，还可以将基金持仓结构的变化与()的变化进行对比分析.从而了解基金的资产配置情况与能力。

- A.市场价格
- B.个股收益
- C.基金交易量
- D.基准指数

答案 : D

第 4 题.()是指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动损益)扣除相关费用的余额，是将本期利润扣除本期公允价值变动损益后的余额，反映基金本期已经实现的损益。

- A.本期利润
- B.本期已实现收益
- C.期末可供分配利润
- D.未分配利润



扫码下载 233 网校题库
一刷就过，千万人掌上题库！

答案 : B

第 5 题. 合格境内机构投资者开展境外证券投资业务，应当由()负责资产托管业务，可以委托()代理买卖证券。

- A. 境内资产托管机构 : 境内资产托管机构
- B. 境内资产托管机构 : 境外证券服务机构
- C. 境外证券服务机构 : 境内资产委托机构
- D. 境外证券服务机构 : 境外证券服务机构

答案 : B

第 6 题. 银行承兑汇票的业务主要体现在银行承兑汇票的承兑和贴现业务上，在我国全部票据业务中占比超过()。

- A. 50%
- B. 60%
- C. 80%
- D. 90%

答案 : D

第 7 题. 利用随机变量期望的线性性质，我们可以计算以()分配资金构造资产组合的总体期望收益率。

- A. 规定比例
- B. 任意比例
- C. 资本金比例
- D. 缴存比例

答案 : B

第 8 题. 下列关于金融衍生工具不是在非金融变量的基础上开发的是()。

- A. 用于管理金融风险的金融期权合约
- B. 用于管理气温变化风险的天气期货合约
- C. 用于管理政治风险的政治期货合约
- D. 用于管理巨灾风险的巨灾衍生产品

答案 : A

第 9 题. ()是仅次于纽约证券交易所的世界第二大证券市场。

- A. 新加坡证券交易所
- B. 香港交易所
- C. 东京证券交易所
- D. 伦敦证券交易所

答案 : C

第 10 题. 影响个人投资者投资需求的基本因素是其()。

- A. 风险承受能力
- B. 资产状况



扫码下载 233 网校题库
一刷就过，千万人掌上题库！

C. 在生命周期所处的阶段

D. 投资知识和经验

答案 : C

第 11 题. 根据《上海证券交易所融资融券交易实施细则》，用于融资融券的标的证券上市交易的时间需超过()个月。

A. 6

B. 12

C. 3

D. 9

答案 : C

第 12 题. 下列关于市场风险管理的主要措施中，表述正确的是()。

I 关注投资组合的风险调整后收益，可以采用夏普比率、特雷诺比率和詹森利率等指标衡量

II 加强对重大投资的检测，对基金重仓股，单日个股交易量占该股票持仓显著比例，个股交易量占该股流通值显著比例等进行跟踪分析

III 加强对场内交易的监控，确保所有交易在公司的管理范围之内

IV 密切关注宏观经济指标和趋势，重大经济动向，重大市场行动，评估宏观因素变化可能给投资带来的系统性风险，定期监测投资组合的风险控制指标，提出应对策略

A. I 、 II 、 III

B. I 、 II 、 IV

C. I 、 III 、 IV

D. I 、 II 、 III 、 IV

答案 : B

第 13 题. 下列关于全球投资业绩标准(GIPS)的要求说法中，正确的是()。

I 该标准的作用是通过制定表现报告确保投资表现结果获得充分的声明和披露

II 投资组合的收益必须以期初资产值加权计算，或采用其他能反映期初价值及对外现金流的方法

III 在计算不同时期的回报率时，必须用几何平均方式相连接

IV 可以采用除时间加权收益率以外的收益率计算方法

A. I 、 II 、 III

B. I 、 II 、 IV

C. I 、 III 、 IV

D. I 、 II 、 III 、 IV

答案 : A

第 14 题. 有下列哪些条件时，可以很容易算出投资组合的预期收益率的方差()。

I 两个风险资产各自的预期收益率

II 两个风险资产各自的收益率方差

III 两个风险资产之间的协方差



扫码下载 233 网校题库
一刷就过，千万人掌上题库！

IV 两个风险资产的投资比例

A. I 、 II 、 IV

B. I 、 II 、 III

C. II 、 III 、 IV

D. I 、 III 、 IV

答案 : C

第 15 题. 行业因素主要包括()。

I 行业生命周期

II 行业景气度

III 行业法令措施

IV 其他影响行业价值面的因素

A. I 、 II 、 IV

B. I 、 III 、 IV

C. II 、 III 、 IV

D. I 、 II 、 III 、 IV

答案 : D

第 16 题. 根据《公开募集证券投资基金管理办法》有关规定 : 封闭式基金的收益分配 , 每年不得少于()次 ; 封闭式基金年度收益分配比例不得低于基金年度可供分配利润的()。

A. 一次 ; 90%

B. 一次 : 80%

C. 两次 ; 90%

D. 两次 : 80%

答案 : A

第 17 题. 投资机会的多少与对投资机会的使用效率存在()的关系。

A. 负相关

B. 正相关

C. 不确定

D. 相互替代

答案 : D

第 18 题. 持仓集中度分析是通过计算前()只股票占基金的比例来分析基金是否倾向于集中投资。

A. 10

B. 15

C. 20

D. 5

答案 : A

第 19 题. 衍生工具的价值取决于()基础资产。



扫码下载 233 网校题库
一刷就过，千万人掌上题库！

A.一种

B.两种

C.多种

D.一种或多种

答案 : D

第 20 题.对于投资对象国而言 , () 基金在()证券市场上投资 , 购买()证券市场上的投资产品 , 是一种较好的融资方式。

A.本国 ; 本国

B.本国 ; 国外 ; 本国

C.国外 ; 本国 ; 本国

D.国外 ; 本国 ; 国外

答案 : C

第 21 题.下列关于基金估值的说法中 , 错误的是()。

I 确定基金资产公允价值的过程

II 通过对基金所拥有的所有负债按一定的原则和方法进行估算

III 通过对基金所拥有的全部资产按一定的原则和方法进行估算

IV 确定基金资产时间价值的过程

A. I 、 II

B. I 、 III

C. II 、 III

D. II 、 III 、 IV

答案 : D

第 22 题.我国的国债期限结构以()为主。

A.短期

B.中期

C.长期

D.超长期

答案 : B

第 23 题.企业持有一张带息的商业汇票 , 面额 5000 元 , 票面利率 6% , 3 个月到期 , 利息是()元。

A.58

B.68

C.75

D.100

答案 : C

第 24 题.指数基金的风险指标主要是()。

A.标准差



扫码下载 233 网校题库
一刷就过 , 千万人掌上题库 !

B.方差

C.β系数

D.跟踪误差

答案 : D

第 25 题.按回购期限划分 , 下列不是我国在交易所挂牌的国债回购的是()。

A.隔夜回购

B.2 天 233 网校

C.91 天 www.233.com

D.365 天

答案 : D

第 26 题.我们常用散点图来直观判断()变量之间的相关性。

A.两个 233 网校

B.三个

C.多个

D.相关

答案 : A

第 27 题.下列对可回售债券的说法中 , 正确的是()。

I 大部分可回售债券约定在发行一段时间后才可以执行回售权 , 回售价格一般高于债券的面值

II 可回售债券的受益人是持有者

III 和一个其他属性相同但没有回售条款的债券相比 , 可回售债券的利息更低

IV 可回售条款可降低投资者的价格下跌风险

A. I 、 III 、 IV

B. I 、 II 、 III 、 IV

C. II 、 III 、 IV

D. I 、 II 、 IV

答案 : C

第 28 题.下列对被动投资的描述中 , 正确的是()。

I 被动投资试图复制某一业绩基准 , 通常是指数的收益和风险

II 投资经理不会尝试利用基本面分析找出被低估或高估的股票

III 投资经理会试图利用技术分析或者数量方法预测市场的总体走势 , 并根据市场走势相机地调整股票组合

IV 作为被动投资者 , 其目标就是在成本允许的情况下 , 尽可能地减少跟踪误差

A. I 、 II 、 III 、 IV

B. I 、 II 、 III

C. I 、 II 、 IV

D. II 、 III 、 IV



扫码下载 233 网校题库
一刷就过 , 千万人掌上题库 !

答案 : C

第 29 题.下列对股票拆分的说法中 , 正确的是()。

- I 股票拆分 , 又称股票拆细 , 即将一股面值较大的股票拆分成几股面值较小的股票
 - II 股票拆分对公司的资本结构会产生一定的影响
 - III 股票拆分会使发行在外的股票总数增加 , 每股面值降低
 - IV 股东的持股比例和权益总额及其各项权益余额都保持不变
- A. I 、 II 、 IV
B. I 、 III 、 IV
C. I 、 II 、 III 、 IV
D. I 、 II 、 III

答案 : B

第 30 题.下列哪些属于互换合约()。

- I 利率互换合约
 - II 股权互换合约
 - III 信用违约互换合约
 - IV 利率期货合约
- A. I 、 III 、 IV
B. I 、 II 、 III
C. I 、 II 、 IV
D. II 、 III 、 IV

答案 : B

第 31 题.根据三大财务报表的信息 , 投资者可以了解() :

- I 企业财务状况
 - II 计算财务比率
 - III 分析企业的营运状况、价值
 - IV 分析企业的风险特征
- A. I 、 II 、 III
B. I 、 II 、 III 、 IV
C. I 、 III 、 IV
D. I 、 II 、 IV

答案 : B

第 32 题.下列不属于基金利息收入的是()。

- A. 债券利息收入
- B. 资产支持证券利息收入
- C. 存款利息收入
- D. 资产估值引起的资产价值变动



扫码下载 233 网校题库
一刷就过 , 千万人掌上题库 !

答案 : D

第 33 题.对于一些重大事务的决定 , 如公司合并、分立、解散等需要()。投票表决通过。

A.独立董事

B.股东

C.执行董事

D.监事

答案 : B

第 34 题.合格境外机构投资者在经批准的投资额度内 , 可以投资于()。

I 在证券交易所交易或转让的股票、债券和权证

II 在银行间债券市场交易的固定收益产品

III 证券投资基金

IV 股指期货

A. I 、 II 、 III

B. II 、 III 、 IV

C. I 、 III 、 IV

D. I 、 II 、 III 、 IV

答案 : D

第 35 题.基金资产估值程序包括()。

I 基金份额净值是按照每个开放日闭市后 , 基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算

II 由基金管理人进行基金日常估值

III 基金资产净值估值完成后 , 将估值结果发给基金托管人

IV 由基金销售机构进行基金日常估值

A. I 、 II 、 III

B. I 、 II 、 IV

C. II 、 III 、 IV

D. I 、 II 、 III 、 IV

答案 : A

第 36 题.某公司营业收入 500 万 , 销售收入 450 万 , 运营成本 350 万 , 销售费用 100 万 , 税费 75 万 , 求销售利润率。

A.11.1%

B.10%

C.72.2%

D.16.7%

答案 : D

第 37 题.()是指对于含有提前赎回条款的公司债 , 发行公司可能在市场利率大幅下降时行使相关权利在到期日前赎回债券。



扫码下载 233 网校题库
一刷就过 , 千万人掌上题库 !

A. 提前赎回风险

B. 经济周期性波动风险

C. 购买力风险

D. 信用风险

答案 : A

第 38 题. 根据《营业税改征增值税试点有关事项的规定》, 机构投资者进行金融商品的转让, 应缴纳增值税, 下列属于金融商品转让的是().

I 买卖基金份额

II 购入基金产品

III 购入信托产品

IV 购入理财产品

A. I

B. I 、 II

C. I 、 II 、 III

D. I 、 II 、 III 、 IV

答案 : A

第 39 题. 下列关于期货合约的交易单位说法中, 错误的是().

A. 交易单位, 也称合约规模

B. 交易单位是指在期货交易所交易的每一份期货合约上所规定的交易数量

C. 在交易期货合约时, 不一定要以交易单位的整数倍进行买卖

D. 一般来说, 某种标的资产的市场规模较大, 交易者的资金规模比较大, 则这种期货合约的交易单位就可以相应地设计得比较大

答案 : C

第 40 题. () 是资本运作的一种方式, 属于间接上市方法, 为不能直接进行 IPO 的私募股权投资项目提供退出途径。

A. 买壳或借壳上市

B. 二次出售

C. 首次公开发行

D. 管理层回购

答案 : A

第 41 题. 关于被动投资与跟踪误差, 以下表述错误的是().

A. 被动投资执行的越差, 跟踪误差越小

B. 被动投资构建的组合与目标指数相比跟踪误差尽可能小

C. 被动投资试图复制某一业绩基准即指数的收益和风险

D. 跟踪误差主要衡量一个股票组合相对于基准组合的偏离程度

答案 : A



扫码下载 233 网校题库
一刷就过, 千万人掌上题库 !

第 42 题.下列选项中 , 不属于银行间债券市场的交易品种的是()。

- A. 债券
- B. 回购
- C. 远期交易
- D. 股票

答案 : D

第 43 题.下列关于证券市场线和资本市场线的区别中 , 说法正确的是()。

- I 在风险的衡量上 , SML 是用 β 值来衡量 , CML 是用标准差来衡量
- II 在应用上 , CML 决定资产最合理的预期收益率(定价) , SML 决定最适合的资产配置点(资产配置)
- III 斜率上 , SML 是市场组合的风险溢价 , CML 是市场组合的夏普比率
- IV 在适用范围上 , CML 是单个资产或投资组合 , 也可以是有效投资组合和无效投资组合 , SML 只适用于有效投资组合

A. I 、 II 、 III 、 IV

B. I 、 II 、 III

C. I 、 III

D. II 、 IV

答案 : C

第 44 题.下列有关并购投资的说法中 , 错误的是()。

- A. 并购投资包括杠杆收购和管理层收购等不同类型
- B. 并购投资的主要对象是成熟且具有稳定现金流且呈现稳定增长趋势的企业
- C. 杠杆收购是指投资者利用收购的资产作为债务抵押进行收购的策略
- D. 管理层收购中借贷款息通过被收购公司的未来现金流来支付

答案 : D

第 45 题.下列对相关系数的说法中 , 错误的是()。

- A. 相关系数 P_{ij} 总处于 $+1 \sim -1$, 即 $P_{ij} \leq -1$, $P_{ij} \geq 1$
- B. $P_{ij}=1$, 则表示 r_i 和 r_j 完全正相关
- C. $P_{ij}=-1$, 则表示 r_i 和 r_j 完全负相关
- D. $P_{ij}=0$, 则表示 r_i 和 r_j 完全零相关

答案 : A

第 46 题.下列有关投资交易流程中交易指令在基金公司内部执行情况 , 正确的有()。

- I 首先 , 在自主权限内 , 投资总监通过交易系统向交易室下达交易指令
 - II 其次 , 交易总监审核投资指令的合法合规性 , 并将指令分派给交易员
 - III 最后 , 交易员接收到指令后有权根据自身对市场的判断选择合适的时机完成交易
- A. I 、 II 、 III
 - B. II 、 III
 - C. I 、 III



扫码下载 233 网校题库
一刷就过 , 千万人掌上题库 !

D. I 、 II

答案 : B

第 47 题.下列关于投资基金国际化的产生与发展 , 说法错误的是()。

- A. 投资基金的国际化是伴随着经济全球化、证券市场国际化的发展趋势而出现的
- B. 投资基金进行跨境投资、销售或管理 , 被称为投资基金国际化
- C. 从 20 世纪 90 年代开始 , 随着金融及投资市场出现国际一体化的大发展 , 基金的运营及销售出现了国际化的趋势
- D. 从 20 世纪 80 年代开始.随着金融及投资市场出现国际一体化的大发展 , 基金的运营及销售出现了国际化的趋势

答案 : C

第 48 题.资产证券化主要分为()。

- I 固定资产抵押贷款支持证券
- II 住房抵押贷款支持证券
- III 股票抵押支持证券
- IV 资产支持证券

A. I 、 III

B. I 、 III 、 IV

C. II 、 IV

D. I 、 II 、 IV

答案 : C

第 49 题.下列关于证券交易所的说法中 , 正确的是()。

- I 是进行证券交易的场所 , 本身不持有证券
- II 进行证券的买卖 , 决定证券交易的价格
- III 组织形式有会员制和公司制两种
- IV 其设立和解散由国务院证券监督管理机构决定

A. I 、 II 、 III

B. II 、 III 、 IV

C. I 、 III 、 IV

D. I 、 II 、 IV

答案 : C

第 50 题.下列有关普通投资者和专业投资者说法中 , 错误的是()。

- A. 专业投资者具备专业的投资知识和经验.在财务上能承担相应的投资风险
- B. 资产管理机构在面对专业投资者时可适当豁免部分适当性义务
- C. 普通投资者处于信息不对称的地位.因此其在信息告知、风险警示、适当性匹配等享有特别保护
- D. 普通投资者和专业投资者不可以相互转化

答案 : D



扫码下载 233 网校题库
一刷就过 , 千万人掌上题库 !

第 51 题.全球投资业绩标准关于收益率计算的具体条款包括()。

- I 自 2005 年 1 月 1 日起 , 必须采用经每日加权现金流调整后的时间加权收益率
 - II 自 2006 年 1 月 1 日起 , 公司必须至少每季度一次计算组合群收益
 - III 自 2010 年 1 月 1 日起 , 必须在所有出现大额对外现金流的日子对投资组合进行实际估值
 - IV 自 2010 年 1 月 1 日起 , 必须至少每月一次计算组合群收益 , 并使用个别投资组合的收益以资产加权计算
- A. I 、 II 、 III
B. I 、 II 、 IV
C. I 、 III 、 IV
D. I 、 II 、 III 、 IV

答案 : D

第 52 题.互换合约是指交易双方约定在()相互交换某种合约标的资产的合约。

- A. 过去某一时期
- B. 过去确定时间
- C. 未来某一时期
- D. 未来确定时间

答案 : C

第 53 题.另类投资的主要类型包括()。

- I 另类资产
 - II 另类投资策略
 - III 私募股权
 - IV 对冲基金
- A. I 、 II
B. I 、 III
C. I 、 II 、 III
D. I 、 II 、 III 、 IV

答案 : D

第 54 题.关于基金业绩评价 , 以下表述正确的是()。

- I 不同基金在不同时间区间内的收益不可比 II 不同基金在不同时间区间内的风险不可比 III 不同基金在不同时间区间内的收益可比 IV 不同基金在不同时间区间内的风险可比

- A. I 、 IV
B. III 、 IV
C. I 、 II
D. II 、 III

答案 : C

第 55 题.下列不是浮动利率的同业存单发行期限的是()。



扫码下载 233 网校题库
一刷就过 , 千万人掌上题库 !

A.6 个月

B.1 年

C.2 年

D.3 年

答案 : A

第 56 题.()是指基金经营活动中因买卖股票、债券、资产支持证券、基金等实现的差价收益，因股票、基金投资等获得的股利收益，以及衍生工具投资产生的相关损益，如卖出或放弃权证、权证行权等实现的损益。

A.利息收入

B.投资收益

C.公允价值变动损益

D.未分配利润

答案 : B

第 57 题.以下不属于债券基金主要的投资风险是()。

A.信用风险

B.汇率风险

C.利率风险

D.提前赎回风险

答案 : B

第 58 题.下列关于远期合约和期货合约的说法中，错误的是()。

A.远期合约是一种最简单的衍生品合约

B.远期合约通常用实物交割

C.期货合约与远期合约相比，期货合约相对而言比较灵活

D.期货合约在交易所中交易，一般用现金进行结算

答案 : C

第 59 题.下列对零息债券的说法中，正确的是()。

I 零息债券在偿还期限期间不支付利息，在到期日一次性支付利息和本金

II 零息债券以低于面值的价格发行，到期 Et 支付的面值和发行价格的差额即为投资者的收益

III 许多偿还期是 1 年或 1 年以下的债券以零息债券的方式发行

IV 偿还期在 1 年以上的零息企业债券，由于利息和本金在到期日一次性支付，其风险较大

A. I 、 III 、 IV

B. I 、 II 、 III 、 IV

C. II 、 III 、 IV

D. I 、 II 、 IV

答案 : B

第 60 题.基金估值程序主要参与者包括()。



扫码下载 233 网校题库
一刷就过，千万人掌上题库！

- I 基金托管人
II 基金管理人
III 基金注册登记机构
IV 中国证券投资基金业协会

- A. I 、 II 、 III
B. I 、 II 、 IV
C. II 、 III 、 IV
D. I 、 II 、 III 、 IV

答案 : A

第 61 题.当物价不断上涨时 , 名义利率比实际利率()。

- A. 低
B. 相等
C. 高
D. 没关系

答案 : C

第 62 题.股票的市场价格一般是指股票在()上买卖的价格。

- A. 一级市场
B. 二级市场
C. 三级市场
D. 四级市场

答案 : B

第 63 题.基金的会计核算对象不包括()。

- A. 资产类
B. 资产负债共同类
C. 资产损益共同类
D. 所有者权益类

答案 : C

第 64 题.在美国纽约证券交易所 , 每个()不仅可以全权负责一种证券的交易 , 而且可以同时为多种股票做市。

- A. 多元做市商
B. 单元做市商
C. 特定做市商
D. 特殊做市商

答案 : C

第 65 题.债券基金的久期越长 , 净值随利率的波动幅度(), 所承担的利率风险就()。

- A. 越小 : 越低



扫码下载 233 网校题库
一刷就过 , 千万人掌上题库 !

B.越小;越高

C.越大;越高

D.越大;越低

答案 : C

第 66 题.下列有关投资组合管理的基本步骤说法中 , 错误的是()。

A. 投资政策说明书是所有投资决策制定的指导性文件

B. 战略资产配置可针对单一周期或多个周期进行

C. 在战略资产配置中 , 投资管理人结合投资政策说明书和资本市场预期来决定各类目标资产的配置

D. 在战略资产配置中 , 制定各类资产权重的上限作为投资过程中风险控制的依据

答案 : D

第 67 题.下列关于 QDII 机制的意义 , 说法正确的是()。

I 为境内金融资产提供风险分散渠道

II 引导国内居民通过正常渠道参与境外证券投资

III 支持香港特区的经济发展

IV 促进我国金融法律法规与世界金融制度的接轨

A. I

B. I 、 II

C. I 、 II 、 III

D. I 、 II 、 III 、 IV

答案 : D

第 68 题.下列不是发行主体为满足流动资金的需求所发行的期限的是()。

A. 2 天

B. 180 天

C. 270 天

D. 360 天

答案 : D

第 69 题.回购市场目前以()为主要交易品种。

A. 质押式回购

B. 买断式回购

C. 封闭式回购

D. 开放式回购

答案 : A

第 70 题.若名义利率为 10% , 通货膨胀率为 4% , 则实际利率为()。

A. 5.77%

B. 6.00%

C. 10.00%



扫码下载 233 网校题库
一刷就过 , 千万人掌上题库 !

D.14.40%

答案 : B

第 71 题.除中国证监会另有规定外 , QDII 基金不得有下列行为()。

- I 购买不动产
- II 购买贵重金属或代表贵重金属的凭证
- III 参与未持有基础资产的卖空交易
- IV 投资于政府债券、公司债券、可转换债券、住房按揭支持证券等

A. I 、 II 、 III

B. II 、 III 、 IV

C. I 、 III 、 IV

D. I 、 II 、 III 、 IV

答案 : A

第 72 题.不属于基金暂停估值的情形是()。

- A.基金投资所涉及的证券交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时
- B.因不可抗力或其他情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时
- C.占基金很小比例的投资品种的估值出现重大转变 , 而基金管理人为保障投资人的利益已决定延迟估值
- D.如出现基金管理人认为属于紧急事故的任何情况 , 会导致基金管理人不能出售或评估基金资产的

答案 : C

第 73 题.关于股票基金的 β 系数 , 以下说法错误的是()。

- I 可以用 β 系数大小衡量股票基金面临市场风险的大小
- II β 系数大于 1 , 股票指数上涨 1% , 基金净值增长率涨 1%
- III β 系数小于 1 , 该基金是一只活跃或激进型基金
- IV β 系数大于 1 , 该基金是一只稳定或防御性基金

A. I 、 II 、 III

B. I 、 II 、 IV

C. I 、 III 、 IV

D. II 、 III 、 IV

答案 : D

第 74 题.合伙型基金参与主体不包括()。

- A.普通合伙人
- B.有限合伙人
- C.基金投资人
- D.基金管理人

答案 : C

第 75 题.股票的市场价格会受()的影响。



扫码下载 233 网校题库
一刷就过 , 千万人掌上题库 !

I 市场的供求关系

II 市场情绪

III 技术 www.233.com

IV 投机

A. I 、 II 、 IV

B. I 、 III 、 IV

C. II 、 III 、 IV

D. I 、 II 、 III 、 IV

答案 : D

第 76 题.下列关于个人投资者的个人状况影响其投资需求的说法中 , 正确的是()。

A. 拥有稳定工作的年轻个人投资者的风险承受能力较弱

B. 处于失业状态的个人投资者的风险承受能力较强

C. 个人投资者的年龄也会影响其投资需求和投资决策

D. 随着年龄的增长 , 个人投资者的风险承受能力递增

答案 : C

第 77 题.某企业的一项投资项目 , 预计 10 年后可获得收益 200 万元 , 年利率为 10% , 按复利计算 , 则该项目现在的价值为()万元。

A. 60.9

B. 62.8

C. 66.4

D. 77.1

答案 : D

第 78 题.下列有关有效市场的类型中 , 说法正确的是()。

A. 弱有效市场认为股价已反映了所有的公开信息

B. 强有效市场指股价反映了全部与公司有关的信息 , 包括所有公开信息和内部信息

C. 半弱有效市场认为股价已反映了所有公开信息

D. 半强有效市场认为股价已反映了全部能从市场交易数据中得到的信息

答案 : B

第 79 题.债权资本的利息高低与()相关。

A. 公司经营的风险

B. 公司管理的风险

C. 公司信用风险

D. 公司操作的风险

答案 : A

第 80 题.已知某基金近三年来累计收益率为 26% , 那么应用几何平均收益率计算的该基金的年平均收益率为()。



扫码下载 233 网校题库
一刷就过 , 千万人掌上题库 !

A.8.01%

B.7.36%

C.8.22%

D.7.54%

答案 : A

第 81 题.根据利息支付方式不同 , 货币互换可分为()。

I 固定对固定

II 固定对浮动

III 浮动对固定

IV 浮动对浮动

A. I 、 III 、 IV

B. I 、 II 、 III

C. I 、 II 、 IV

D. II 、 III 、 IV

答案 : C

第 82 题.假设某基金某日持有的某三种股票的数量分别为 100 万股、 500 万股和 1000 万股 , 每股的收盘价分别为 30 元、 20 元和 10 元 , 银行存款为 10000 万元 , 对托管人或管理人应付未付的报酬为 5000 万元 , 应付税费为 5000 万元 , 已售出的基金份额为 20000 万份。则基金份额净值不为()元。

I 1.15

II 2.25

III 1.05

IV 1.25

A. I

B. I 、 II 、 IV

C. II 、 III 、 IV

D. I 、 II 、 III 、 IV

答案 : C

第 83 题.证券登记结算机构须采取以下()措施保证业务的正常运行。

I 制定完善的风险防控机制和内部控制制度

II 建立完善的技术系统 , 制定由结算参与人共同遵守的技术标准和规范

III 建立完善的结算参与人准入标准和风险评估体系

IV 对结算数据和技术系统进行备份 , 制定业务紧急应变程序和操作流程

A. I 、 II

B. I 、 IV

C. II 、 III 、 IV

D. I 、 II 、 III 、 IV



扫码下载 233 网校题库
一刷就过 , 千万人掌上题库 !

答案 : D

第 84 题.通过对()和()的比较分析 , 可以了解投资者对该基金的认可程度。

- A. 基金盈利能力 : 持有人结构
- B. 基金盈利能力 : 基金分红能力
- C. 基金份额变动情况 : 持有人结构
- D. 基金份额变动情况 : 基金分红能力

答案 : C

第 85 题.关于债券的发行主体 , 以下表述正确的是()。

- I 国债是财政部代表中央政府发行的
- II 国债属于商业银行债券
- III 地方政府债由中央政府负责偿还
- IV 特种金融债券的发行必须经中国人民银行批准

A. II 、 III 、 IV

B. I 、 III 、 IV

C. I 、 II 、 IV

D. I 、 IV

答案 : D

第 86 题.证券市场的主要交易模式是 “一手交钱 , 一手交货” , 即如果投资者要买入一定数量的证券必须具有与市场价格等值的货币资金 , 如果投资者要卖出证券 , 证券账户上必须有属于投资者支配范围内的足量的可交易证券 , 这样的交易称为()。

A. 保证金交易

B. 信用交易

C. 期货交易

D. 现货交易

答案 : D

第 87 题.香港交易所规定交易所参与者必须于每个交易日后第二个交易日下午()前与中央结算系统完成收成。

A. 2 : 45

B. 3 : 00

C. 3 : 30

D. 3 : 45

答案 : D

第 88 题.通过分析企业资产负债表 , 能够揭示企业()。

I 资产要素的信息

II 长期或短期偿还债务能力

III 一定时期的业务经营状况



扫码下载 233 网校题库
一刷就过 , 千万人掌上题库 !

IV 资本结构是否合理

- A. I 、 II 、 III
- B. I 、 III 、 IV
- C. II 、 III 、 IV
- D. I 、 II 、 IV

答案 : D

第 89 题.对下列收入征收企业所得税的是()。

- I 买卖股票、债券的差价收入
 - II 股权的股息、红利收入
 - III 基金取得的股利收入
 - IV 储蓄存款利息收入
- A. I 、 II
 - B. II 、 III
 - C. III 、 IV
 - D. I 、 II 、 III

答案 : C

第 90 题.现券交易的结算按单一券种办理 , 结算日为(), 可以选择任意一种结算方式

- A.T+0
- B.T+0 或 T+1
- C.T+1 或 T+2
- D.T+1

答案 : B

第 91 题.在报价驱动中 , 做市商通常由具备一定实力和信誉的()承担。

- A.证券经纪商
- B.证券投资法人
- C.证券投资顾问
- D.证券分析师

答案 : B

第 92 题.我国的商品期货市场开始于()。

- A.20 世纪 60 年代
- B.20 世纪 70 年代
- C.20 世纪 80 年代
- D.20 世纪 90 年代

答案 : D

第 93 题.某 2 年期债券的面值为 1000 元 , 票面利率为 6% , 每年付息一次 , 现在市场收益为 8% , 其市场价格为 964.29 元 , 则麦考利久期为()。



扫码下载 233 网校题库
一刷就过 , 千万人掌上题库 !

A.1.94 年

B.2.04 年

C.1.75 年

D.2 年

答案 : A

第 94 题.假如单利终值为 FV , 年利率为 i , 计息时间为 t , 则单利现值的计算公式为()。

A.PV=FV×i×t

B.PV=FV/(i×t+1)

C.PV=FV×(i×t-1)

D.PV=FV×(1-i×t)

答案 : B

第 95 题.信用风险的监控指标主要有债券基金所持有债券的()等。

A.信用等级、控制企业债比例

B.平均信用等级、各信用等级债券所占比例

C.平均市净值和平均市净率

D.平均市值和平均市盈率

答案 : B

第 96 题.基于组合的风格分析方法排序正确的是()。

I 根据每只基金所持股票特征值计算出该基金在每一项特征上的加权平均值 , 同时比照股票分档点归档

II 将市场上所有股票分别按照相关特征分档

III 计算所有基金在每项特征上的平均值 , 与市场上所有股票在相应特征上的平均值比较

IV 评价基金的总体投资风格

A. I 、 II 、 III 、 IV

B. II 、 I 、 III 、 IV

C. II 、 III 、 I 、 IV

D. III 、 II 、 I 、 IV

答案 : B

第 97 题.基金管理公司的投资部门设置大致包括()。

I 投资决策委员会

II 投资部

III 研究部

IV 交易部

V 董事会

A. I 、 II 、 III 、 IV

B. I 、 II 、 III 、 V



扫码下载 233 网校题库
一刷就过 , 千万人掌上题库 !

C. I、III、IV、V

D. I、II、III、IV、V

答案 : A

第 98 题.所有者权益包括()。

I 股本

II 资本公积

III 盈余公积

IV 未分配利润

A. I、II、III

B. I、III、IV

C. II、III、IV

D. I、II、III、IV

答案 : D

第 99 题.1952 年 , 25 岁的哈里·马科维茨在《金融杂志》上发表了一篇题为 “资产组合的选择” 的文章 , 首次提出了() , 奠定了投资组合理论的基础 , 标志着现代投资组合理论的开端。

A. 资产定价模型

B. 均值一方差模型

C. 套利定价理论

D. 期权定价模型

答案 : B

第 100 题.()是目前世界上影响最大、最有权威性的一种股票价格指数 , 于 1896 年 5 月 26 日问世。

A. 道琼斯股票价格平均指数

B. 标准普尔 500 指数

C. 上证股票价格指数

D. 日经指数

答案 : A

答案及解析请访问地址 : <http://m.wx.233.com/webapp/tiku/explain/MockAd?classId=1004>

如何在线测试这套题 :

APP 用户打开 233 网校 APP——选择 “基金从业” ——点击右下角 “题库” —— “模考大赛” 按钮——开始挑战。



扫码下载 233 网校题库
一刷就过 , 千万人掌上题库 !



233网校
www.233.com



扫码下载 233 网校题库
一刷就过，千万人掌上题库！