

2018 年 10 月基金从业考试《证券投资基金基础知识》模考大赛试卷四

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.研究随机变量 X 以特定概率(或者一组数据以特定比例)取得大于等于(或小于等于)某个值的情况的是()。

- A.中位数
- B.平均数
- C.分位数
- D.标准差

答案：C

第 2 题.下列关于股票投资组合构建策略说法中，错误的是()。

- A.自下而上策略主要关注个股的选择，在实施过程中有固定的模式
- B.自上而下策略从宏观形势及行业、板块特征入手，明确大类资产、国家、行业的配置
- C.自下而上则是依赖个股筛选的投资策略，关注的是各个公司的表现，而非经济或市场的整体趋势
- D.自下而上的选股理念在市场存在众多的定价无效的情况下能够发挥很好的作用

答案：A

第 3 题.资产支持证券的发行和住房抵押贷款支持证券类似，其贷款种类是其他债务贷款，如()。

- I 汽车消费贷款
- II 学生贷款
- III 住房贷款
- IV 信用卡应收款

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

答案：D

第 4 题.复利中的计息期是指相邻()次计息的时间间隔。

- A.一
- B.两
- C.三
- D.四

答案：B

第 5 题.下列关于机构投资者买卖基金应缴纳的税收说法中，正确的是()。

- I 对内地企业投资者通过基金互认买卖香港基金份额取得的转让差价所得，计入其收入总额，依法征收企业所得税
- II 对内地企业投资者通过基金互认从香港基金分配取得的收益，计入其收入总额，依法征收企业所得税
- III 机构投资者买卖基金份额暂免征收印花税
- IV 机构投资者买卖基金份额的行为免征增值税



扫码下载 233 网校题库
一刷就过，千万人掌上题库！

A. I、II、III

B. II、III、IV

C. I、III、IV

D. I、II、III、IV

答案：A

第 6 题.()是由全美证券交易商协会创立并负责管理，是全球第一个电子交易市场。

A. 纽约证券交易所

B. 纳斯达克证券交易所

C. 法兰克福证券交易所

D. 伦敦证券交易所

答案：B

第 7 题.关于汇率风险，以下表述正确的是()：

I QDII 基金投资受汇率影响较普通基金更大

II 汇率风险受国际收支及外汇储备、利率、通货膨胀和政治局势等影响

III 汇率风险指因汇率变动而产生的基金价值的不确定性

IV 汇率风险属于信用风险

A. I、II、III

B. I、II、IV

C. I、III、IV

D. I、II、III、IV

答案：A

第 8 题.下列不是我国同业拆借市场上交易活跃的品种的是()。

A. 1 天

B. 2 天

C. 7 天

D. 14 天

答案：B

第 9 题.常用的技术分析方法有()。

I 道氏理论

II 过滤法则与止损指令

III “相对强度”理论体系

IV “量价”理论体系

A. I、II、IV

B. I、III、IV

C. I、II、III、IV

D. II、III、IV

答案：C

第 10 题.下列关于场内证券交易涉及的过户费的说法中，不正确的是()。



扫码下载 233 网校题库
一刷就过，千万人掌上题库！

- I 上海证券交易所 A 股交易过户费的收费标准为按成交面额的 0.02‰向托管人收取
II 深圳证券交易所 A 股交易过户费的收费标准为按成交面额的 0.75‰向投资者收取
III 上海证券交易所对 B 股不征收过户费，也不征收结算费
IV 深圳证券交易所对 B 股征收结算登记费，是成交金额的 0.5‰，但最高不超过 500 港元

A. I

B. I、II

C. I、II、III

D. II、III、IV

答案：C

第 11 题.投资者购买证券、基金等投资产品，关心的是在持有期间所获得的收益率。持有期间所获得的收益通常来源于()。

A.股息和红利

B.资产回报和收入回报

C.投资收益和股息收益

D.利息收益和价差收益

答案：B

第 12 题.信用风险管理措施包括()。

I 建立针对债券发行人的内部信用评级制度，并结合外部信用评级

II 建立流动性预警机制

III 建立严格信用风险监控体系.对信用风险及时发现汇报和处理

IV 建立交易对手信用评级制度

A. I、II、III

B. I、II、IV

C. I、III、IV

D. I、II、III、IV

答案：C

第 13 题.某一只基金 2 年的累计收益率为 36%，那么该基金的年平均收益率为()。

A.0.177

B.0.18

C.0.166

D.0.146

答案：C

第 14 题.境内机构投资者委托投资顾问进行境外证券投资，该投资者需满足经营投资管理业务达()年以上，最近一个会计年度管理的证券资产不少于()亿美元或等值货币。

A.5;150

B.5;100

C.3;150

D.3;100



扫码下载 233 网校题库
一刷就过，千万人掌上题库！

答案：B

第 15 题.大额可转让定期存单是银行发行的具有固定期限和一定利率的，且可以在()上转让的金融工具。

- A.一级市场
- B.二级市场
- C.三级市场
- D.四级市场

答案：B

第 16 题.内在价值法分为()。

- I 股利贴现模型
- II 自由现金流量贴现模型
- III 经济附加值模型
- IV 市盈率模型

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

答案：A

第 17 题.下列资本市场理论发展形成的先后顺序中，正确的是()。

- A.均值一方差模型—套利定价模型—资产定价模型—期权定价模型
- B.资产定价模型—均值一方差模型—套利定价模型—期权定价模型
- C.均值一方差模型—资产定价模型—套利定价模型—期权定价模型
- D.期权定价模型—均值一方差模型—资产定价模型—套利定价模型

答案：C

第 18 题.分析现金流量表，有助于投资者估计今后企业的()？

- I 偿债能力
- II 获取现金的能力
- III 创造现金流量的能力
- IV 支付股利的能力

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

答案：A

第 19 题.尽管回购协议中的抵押品一般是风险较低的()，但交易过程中仍然存在信用风险。

- A.公司债
- B.企业债
- C.国债
- D.银行贷款



扫码下载 233 网校题库
一刷就过，千万人掌上题库！

答案：C

第 20 题.某基金根据历史数据计算出来的 β 系数为 1.3，以下表述正确的是()。

- I 该基金的净值变动幅度比市场大
- II 该基金的净值变动方向与市场一致
- III 当市场上涨 1%时，该基金净值上涨幅度为 1.3%
- IV 该基金对市场变化的敏感程度不高

A. I、II、III

B. I、II、IV

C. I、III、IV

D. II、III、IV

答案：A

第 21 题.()是为买卖双方介绍交易以获取佣金的中间商人。

A. 经纪人

B. 投资者

C. 做市商

D. 投资顾问

答案：A

第 22 题.下列属于隐性成本的是()。

I 对冲费用

II 佣金

III 机会成本

IV 冲击成本

V 买卖差价

A. I、II、III、IV、V

B. I、II、III、IV

C. II、III、IV、V

D. I、III、IV、V

答案：D

第 23 题.()的目的在于将损失控制在投资者可接受的范围。

A. 限价指令

B. 止损指令

C. 市价指令

D. 触价指令

答案：B

第 24 题.关于全国银行间同业拆借中心，以下表述错误的是()。

A. 对通过交易系统展开的债券交易活动进行监控

B. 为市场投资者提供报价平台

C. 为市场参与主体提供托管，交易结算等服务



扫码下载 233 网校题库
一刷就过，千万人掌上题库！

D.为市场投资者交易提供电子成交登记服务

答案：C

第 25 题.关于利率互换合约的两种形式，以下表述正确的是()。

A.基础互换采用净额支付方式

B.基础互换指双方不同本金的交换

C.息票互换采用全额支付方式

D.息票互换指不同参照利率的互换

答案：A

第 26 题.基金投资交易执行过程中的风险主要体现在()。

A.滚动性风险

B.信用风险

C.操作风险

D.市场风险

答案：C

第 27 题.最直接影响股票的市场价格的因素是()。

A.环境关系

B.信用关系

C.市场关系

D.供求关系

答案：D

第 28 题.以下关于风险的说法中，正确的是()。

I 事后指标则通常用来衡量和预测目前组合在将来的表现和风险情况

II 选择合适的风险测量指标和科学计算方法是正确度量风险的基础

III 风险管理的基础工作是风险的测度

IV 风险测度可以分为事前与事后两类

A. I、II、III

B. I、II、IV

C. II、III、IV

D. I、II、III、IV

答案：C

第 29 题.()一般指短期的、具有高流动性的低风险证券。

A.债券

B.基金

C.股票

D.货币市场基金

答案：D

第 30 题.下列属于期权合约的要素的是()。

I 标的资产



扫码下载 233 网校题库
一刷就过，千万人掌上题库！

II 期权的买方、卖方

III 执行价格、期权费

IV 通知日和到期日

A. I、II、III、IV

B. I、II、III

C. I、II、IV

D. II、III、IV

答案：A

第 31 题.短期政府债券以贴现的形式发行，为()。

A.固定利率债券

B.浮动利率债券

C.零息债券

D.无息票债券

答案：D

第 32 题.基金财务会计报告分析目的不包括()。

A.评价基金过去的经营业绩及投资管理能力

B.保证基金能够持续盈利

C.预测基金未来的发展趋势

D.通过分析基金现时的资产配置及投资组合状况来了解基金的投资状况

答案：B

第 33 题.基金进行利润分配会导致基金份额净值的()，对投资者的利益()。

A.上涨;有影响

B.上涨：没有影响

C.下降;有影响

D.下降：没有影响

答案：D

第 34 题.主动型投资者不会注重寻找的是()。

A.被低估或高估的资产类别

B.被低估或高估的行业

C.被低估或高估的证券

D.被低估或高估的债券

答案：D

第 35 题.下列对固定利率债券的说法中，正确的是()。

I 固定利率债券是由政府和企业发行的主要债券种类

II 没有固定的到期日，并在偿还期内有固定的票面利率和不变的面值

III 市场利率或者发行人的信用等级改变，债券发行人要偿付的利息也随之变化

IV 固定利率债券在偿还期内定期支付利息，并在到期日支付面值

A. I、IV



扫码下载 233 网校题库
一刷就过，千万人掌上题库！

B. I、II、III

C. II、III、IV

D. I、II、IV

答案：A

第 36 题.乙公司有一张带息期票，面额为 18000 元，票面利率为 5%。出票日期为 4 月 15 日，6 月 14 日到期(共 60 天)，则到期日的利息为()元。

A.15

B.120

C.54000

D.150

答案：D

第 37 题.下列有关算法交易的说法中，正确的有()。

I 交易员把指定交易量的交易指令放入模型，并在模型中设定目标，模型根据指令和目标产生执行指令的时机和交易额

II 算法交易通过程序系统交易，将一个大额的交易拆分为多个小额交易，以此尽量减少对市场价格的冲击，降低交易成本

III 算法交易的核心是投资决策模型

IV 算法交易的内在逻辑在于利用市场交易量的特点来风险可控、成本可控地执行订单

A. I、II、III、IV

B. I、II、III

C. I、II、IV

D. II、III、IV

答案：C

第 38 题.以下对基金资产估值需要考虑因素相关内容表述中，正确的有()。

I 当基金只投资于交易活跃的证券时，可直接采用市场交易价格对基金资产估值

II 海外的基金大多数每季度估值一次

III 为了避免出现价格操纵及滥估现象，只能由监管当局对基金资产进行估值

IV 当基金投资于交易不活跃的证券时，对基金资产进行估值需要重点考虑证券资产的流动性

A. I、II、IV

B. I、IV

C. II、III、IV

D. I、II、III、IV

答案：B

第 39 题.下列关于证券回转交易的说法中，正确的是()。

I 证券的回转交易是指投资者买入的证券，经确认成交后，在交收完成前全部或部分卖出

II 债券竞价交易和权证交易实行当日回转交易

III B 股实行当日回转交易

IV 深圳证券交易所对专项资产管理计划收益权份额协议交易实行当日回转交易



扫码下载 233 网校题库
一刷就过，千万人掌上题库！

A. I、II

B. I、II、IV

C. II、III、IV

D. I、II、III、IV

答案：B

第 40 题.2017 年初，某上市公司陷入退市传言，超过 18 家基金公司陆续就该公司股票估值价格发布了下调公告，针对该事项，以下说法正确的是()？

I 基金公司应建立相应的信息披露制度，履行信息披露义务

II 基金管理公司应制定健全有效的估值政策和程序

III 基金管理公司应在估值方法和调整幅度做出重大变化时进行公告或解释

IV 基金管理人调整某特定投资品种的估值前，应就估值方法、调整幅度等方面保持与基金行业一致

A. I、II、III

B. I、II、IV

C. II、III、IV

D. I、II、III、IV

答案：A

第 41 题.普通股股东享有的基本权利，包括()。

I 剩余收益的要求权

II 表决权

III 优先清偿权

IV 监管权

A. I、II、III

B. II、III

C. III、IV

D. I、II

答案：D

第 42 题.CAPM 指的是()。

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：A

第 43 题.在我国，证券投资基金的会计年度为()。

A. 公历每年 1 月 1 日至 12 月 31 日

B. 公历每年 1 月 1 日至 6 月 30 日

C. 阴历每年 1 月 1 日至 12 月 31 日

D. 阴历每年 1 月 1 日至 6 月 30 日

答案：A



扫码下载 233 网校题库
一刷就过，千万人掌上题库！

第 44 题.某项投资拟在 4 年后获得本利和 40000 元，年利率为 6%，按复利计算，则其现值为()元。

A.31580

B.31683

C.31988

D.31790

答案：B

第 45 题.关于 β 系数的说法中，以下正确的是()。

I β 系数是评估证券或投资组合非系统性风险的指标

II β 系数大于 1 时，表明投资组合价格变动方向与市场一致，且变动幅度比市场大

III β 系数反映的是评估证券或投资组合系统性风险的指标

IV β 系数等于 1 时，表明投资者的变动幅度与市场一致

A. I、II、III

B. I、II、IV

C. II、III、IV

D. I、II、III、IV

答案：C

第 46 题.下列关于场内证券交易涉及的费用说法中，不正确的是()。

I 出现的新的交易品种的交易佣金标准进行备案后，30 天内无异议则正式实施

II 深圳证券交易所的过户费包含在交易经手费中，不向投资者单独收取

III 过户费属于中国结算公司的收入，由中国结算公司代为扣收

IV 证券交易印花税只对出让方征收，对受让方不征收

A. I、II

B. I、II、IV

C. II、III、IV

D. I、II、III、IV

答案：D

第 47 题.我国主要是()对行业和企业的景气指数进行调查和定期公布。

I 国务院证券监督管理机构

II 国务院发展研究中心

III 中国证券监督管理委员会

IV 国家统计局

A. I、II、IV

B. II、IV

C. II、III

D. II、III、IV

答案：B

第 48 题.下列属于显性成本的是()。

I 佣金



扫码下载 233 网校题库
一刷就过，千万人掌上题库！

II 经手费

III 监管费

IV 印花税

V 过户费

VI 交易技术供应商的收费

VII 买卖差价

A. I、II、III、IV、V、VI、VII

B. I、II、III、IV、V、VI

C. I、II、IV、V、VI

D. II、III、IV、VI、VII

答案：B

第 49 题.下列有关 GIPS 说法中，正确的有()。

I 为了增加投资管理机构符合 GIPS 标准的可信性，机构可自愿聘请独立第三方审计公司

II GIPS 组合群必须以相同投资目标或策略定义

III GIPS 输入数据规定中，对于固定收益类等应计利息的证券，必须采用收付实现制

IV GIPS 针对缴纳捆绑费用及由第三方管理的独立账户做了额外规定

A. I、II、III

B. I、II、IV

C. I、III、IV

D. I、II、III、IV

答案：B

第 50 题.上海证券交易所规定融资融券业务最长时限为()个月。

A.5

B.6

C.7

D.8

答案：B

第 51 题.交易部是基金投资运作执行的部门，不包括：

A.结算

B.审核

C.反馈

D.执行

答案：A

第 52 题.()是指承销商在发行期内将承销的债券向其他结算成员进行承销额度的过户。

A.分销业务

B.现券业务

C.质押式回购业务

D.买断式回购业务



扫码下载 233 网校题库
一刷就过，千万人掌上题库！

答案：A

第 53 题.一般票据的贴现期不超过()，贴现期从贴现日起计算至票据到期日。

A.3 个月

B.6 个月

C.9 个月

D.1 年

答案：B

第 54 题.场内证券交易清算与交收的原则有()。

I 法人结算原则

II 共同对手方制度

III 货银对付原则

IV 分级结算原则

A. I、II

B. I、II、III

C. II、III、IV

D. I、II、III、IV

答案：D

第 55 题.投资者可以通过股票收益互换实现()的目的。

I 策略投资

II 杠杆交易

III 股权融资

IV 市值管理

A. I、II、III、IV

B. I、II、III

C. I、II、IV

D. II、III、IV

答案：A

第 56 题.下列属于基金利润来源中利息收入的是()。

A.股利收入

B.资产支持证券利息收入

C.手续费返还

D.基金投资收益

答案：B

第 57 题.关于 GIPS 收益率计算的规定，表述错误的是

A.在计算收益时，必须计入投资组合中持有的现金及现金等价物的收益

B.自 2010 年 1 月 1 日起，投资管理机构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

C.投资组合的收益需采用反映期初价值及对外现金流的方法



扫码下载 233 网校题库
一刷就过，千万人掌上题库！

D.必须采用已实现收益率，既包括所有已实现的回报以及损失并加入收入

答案：D

第 58 题.我国货币市场基金不得投资于剩余期限高于()天的债券。

A.180

B.270

C.360

D.397

答案：D

第 59 题.下列关于证券交易所的说法中，不正确的有()。

I 证券交易所应当创造公开、公平、公正的市场环境

II 会员大会是证券交易所的决策机构

III 证券交易所设总经理，由证监会任免

IV 证券交易所的组织形式只有会员制

A. I、II

B. I、II、IV

C. II、III、IV

D. I、II、III、IV

答案：C

第 60 题.某企业持有一张带息商业汇票，面额 1500 元，票面利率 8%，期限为 90 天，则票据到期后价值为()元。

A.1470

B.1530

C.1750

D.1900

答案：B

第 61 题.假如本金为 PV，年利率为 i，计息时间为 t，则单利终值的计算公式为()。

A. $FV = PV \times i \times t$

B. $FV = PV \times (i + t)$

C. $FV = PV \times (i \times t + 1)$

D. $FV = PV \times (i \times t - 1)$

答案：C

第 62 题.期货合约是指交易双方签署的在()按确定的价格买入或卖出某项合约标的资产的合约。

A.过去某一时期

B.过去某一确定时间

C.未来某一时期

D.未来某一确定时间

答案：D

第 63 题.同业拆借的利息是按()结算的。



扫码下载 233 网校题库
一刷就过，千万人掌上题库！

A.日

B.周

C.月

D.年

答案：A

第 64 题.下列说法中，不正确的是()。

A.股票投资策略可分为两大类：主动投资策略和被动投资策略

B.有的主动型投资者试图通过市场择时来获得超额收益

C.在市场定价有效的前提下，想要提高收益，最佳的选择是主动投资策略

D.在现实中，被动投资与主动投资并不是完全对立的，有些投资策略介于二者之间

答案：C

第 65 题.按照衍生工具的产品形态分类，衍生工具可以分为()和()。

A.独立衍生工具，非独立衍生工具

B.嵌入式衍生工具，非嵌入式衍生工具

C.独立衍生工具，嵌入式衍生工具

D.货币衍生工具，利率衍生工具

答案：C

第 66 题.通常对混合型基金的财务会计报表分析不包括()：

A.盈利能力分析

B.持仓结构分析

C.基金业绩分析

D.基金份额变动分析

答案：C

第 67 题.公司的贷款利率一般情况下会()国债利息。

A.低于

B.高于

C.等于

D.不确定

答案：B

第 68 题.关于股票型基金的投资组合构建，以下说法错误的是()。

A.基金股票投资组合构建通常有自上而下和自下而上两种策略

B.基金行业与风格受基金合同约定

C.基金股票投资范围、目标、投资比例都由基金合同约定

D.基金个股选择与投资比例不受约束

答案：D

第 69 题.某投资者将 10 万元用于某项投资，该投资的年报酬率为 10%，投资期间投资者不提取现金，而将本金和报酬继续用于投资，按复利计算，第五年年末该投资者的本利和为()万元。

A.150.02



扫码下载 233 网校题库
一刷就过，千万人掌上题库！

B.161.05

C.165.1

D.168

答案：B

第 70 题.交易过程中的显性成本不包括()。

A.交易佣金

B.过户费

C.买卖价差

D.印花税

答案：C

第 71 题.存款类金融机构在当年发行备案额度内.自行确定每期同业存单的发行金额、期限，但单期发行金额不得低于()元人民币。

A.1000 万

B.2000 万

C.5000 万

D.1 亿

答案：C

第 72 题.衡量基金收益率的标准算法是()。

A.简单净值收益率

B.年(度)化收益率

C.时间加权收益率

D.几何平均收益率

答案：C

第 73 题.下列关于证券发行人的说法中，正确的是()。

I 债券发行人通过发行债券筹集的资金一般都有固定期限，债券到期时债务人必须按时归还本金并支付约定的利息

II 债券是债券凭证，债券持有人与债券发行人之间是债权债务关系

III 债券市场交易的对象是债券

IV 债券因没有固定的票面利率和期限，其市场价格相对股票价格而言不稳定

A. I、III、IV

B. II、III、IV

C. I、II、IV

D. I、II、III

答案：D

第 74 题.关于机构投资者买卖基金涉及的所得税，表述正确的

A.机构投资者从基金分配中获得的收入，暂免所得税

B.内地企业投资者通过基金互认从香港基金分配得到的收益，暂免征所得税

C.机构投资者在境内买卖基金份额获得的差价收入，暂免征所得税



扫码下载 233 网校题库
一刷就过，千万人掌上题库！

D.内地企业投资者通过基金互认买卖基金份额取得的差价收入，暂免征所得税

答案：A

第 75 题.宏观经济指标主要有()。

I 国内生产总值

II 通货膨胀

III 利率、汇率

IV 预算赤字

A. I、II、IV

B. I、III、IV

C. I、II、III、IV

D. I、II、III

答案：C

第 76 题.通货膨胀的预测主要采用物价指数，主要有()。

I 居民消费价格指数

II 生产者物价指数

III 消费者物价指数

IV 商品价格指数

A. I、II、IV

B. I、III、IV

C. I、II、III、IV

D. I、II、III

答案：A

第 77 题.在计算基金的期望回报率时，我们可以用一定时间的()对未来回报率的可能分布作出预测。

A.历史最高回报率

B.历史最低回报率

C.历史平均回报率

D.未来回报率

答案：C

第 78 题.分位数通常被用来研究随机变量 X 以()概率取得大于等于某个值的情况。

A.指定

B.特定

C.任意

D.不确定

答案：B

第 79 题.我国债券通常是()付息一次。

A.季度

B.半年

C.一年



扫码下载 233 网校题库
一刷就过，千万人掌上题库！

D.两年

答案：C

第 80 题.下列关于期货市场的基本功能中，说法正确的是()。

- I 期货市场的基本功能有风险管理、价格发现和投机三种
- II 期货合约具有的价格发现功能以及降低信息不对称的功能，有利于实现社会资源的合理配置
- III 期货市场的一个主要经济功能是为生产、加工和经营者等提供价格风险转移工具
- IV 正是因为有投机者参与，套期保值才能顺利进行，而使期货市场具有经济功能

A. I、II、III、IV

B. I、II、III

C. I、II、IV

D. II、III、IV

答案：A

第 81 题.取甲公司 10 个交易日的收益率为 r 样本，样本值为 $r_1=4.684\%$ ， $r_2=4.597\%$ ， $r_3=4.321\%$ ， $r_4=4.373\%$ ， $r_5=4.280\%$ ， $r_6=4.136\%$ ， $r_7=4.150\%$ ， $r_8=3.982\%$ ， $r_9=4.270\%$ ， $r_{10}=4.261\%$ ，此样本的均值为()。

A.4.207%

B.4.305%

C.4.321%

D.4.373%

答案：B

第 82 题.该指数的一个重要特点在于对异常价格和无价情况使用了模型价，能更为真实地反映债券的实际价值和收益率特征，它是()。

A.深证综合股票价格指数

B.中证全债指数

C.沪深 300 指数

D.上证 180 指数

答案：B

第 83 题.下列关于债券结算方式的说法中，不正确的是()。

A.根据结算指令的处理方式，债券结算可分为实时处理交收和批量处理交收

B.实时处理一般按每个营业日进行，也有按其他时间段进行的

C.批量处理可以以全额结算或净额结算方式进行交收

D.实时处理的全额结算，结算效率较高

答案：B

第 84 题.下列关于影响投资需求的因素表述中，正确的是()。

I 投资期限越长，则投资者能够承担的风险越小

II 长期投资者在遇到投资损失时，可以通过提高储蓄率和调整投资组合构成、提高无风险资产在投资组合中所占比重的方法来弥补

III 通常情况下，要获得高收益率，就必须承担高风险



扫码下载 233 网校题库
一刷就过，千万人掌上题库！

IV 风险承受能力取决于投资者的境况，包括其资产负债状况、收入支出状况和投资期限

V 对于同类商品，流动性更好的具有更高的预期收益率

A. I、II、III

B. II、III、IV

C. II、III、V

D. III、IV、V

答案：B

第 85 题.企业发行短期融资券的主要目的是为了获得()。

A.长期收益

B.短期收益

C.长期流动性

D.短期流动性

答案：D

第 86 题.()，即基金业绩评价应公平对待所有评价对象，具有确定、一致的评价标准。

A.真实性原则

B.客观性原则

C.长期性原则

D.可比性原则

答案：B

参考解析：

第 87 题.下列不属于投资组合管理流程基本步骤的有()。

A.规划

B.执行

C.再平衡

D.反馈

答案：C

第 88 题.按计息方式分类，债券可分为()。

I 固定利率债券

II 浮动利率债券

III 累进利率债券

IV 零息债券

A. II、III

B. I、III、IV

C. I、II、III、IV

D. I、II、IV

答案：D

第 89 题.按照中国银行的规定，任何一家市场参与者在进行买断式回购交易时单只券种的待返售债券余额应小于该只债券流通量的()，任何一家市场参与者待返售债券总余额应小于其在债券登记托管结算机构托



扫码下载 233 网校题库
一刷就过，千万人掌上题库！

管的自营债券总量的()。

- A.20%;200%
- B.20%;100%
- C.10%;200%
- D.10%;100%

答案：A

第 90 题.股票估值可以分为()。

- I 外在价值法
- II 内在价值法
- III 历史价值法
- IV 相对价值法

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

答案：B

第 91 题.反映企业一定时期总体经营成果的会计报表是()。

- A.资产负债表
- B.利润表
- C.所有者权益表
- D.现金流量表

答案：B

第 92 题.以下说法正确的是()。

- I β 系数是常用的风险敏感度指标之一
- II 投资组合波动率在风险管理中最常见的定义是单位时间收益率的标准差
- III 通过计算测量风险因子的变化对组合价值的影响程度就是风险敏感度指标
- IV 风险敏感度是对风险因子的暴露程度

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

答案：A

第 93 题.指数复制的成本不包括()。

- A.佣金等交易费用
- B.建立指数组合的各种费用
- C.管理指数组合的各种费用
- D.复制的手续费用

答案：D



扫码下载 233 网校题库
一刷就过，千万人掌上题库！

第 94 题.GIPS 的特点包括()。

- I 依赖于输入数据的真实性与准确性
- II 其标准包含两套
- III 具有强制性
- IV 规定投资管理机构应将所有可自由支配于预期投资策略及收取管理费的组合，根据相同策略或投资目标，纳入至少一个以上的组合群

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

答案：B

第 95 题.对于技术分析的假定的说法中，正确的是()。

- I 市场行为涵盖一切信息
- II 技术分析的另一条准则是股价具有趋势性运动规律，股票价格沿趋势运动
- III 一家公司盈利、股利和未来业绩变化的有关信息都会自动反映在公司以往价格上
- IV 历史会重演

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

答案：D

第 96 题.规模较大的基金与小规模基金相比，平均成本()。

- A.较低
- B.较高
- C.相等
- D.无法比较

答案：A

第 97 题.市值优先抽样是把证券按市值从大到小排序，选择排名在最前面的证券：然后统计出所选成分证券的总权重，使每只成分证券的配比()该成分证券在总权重中的比例。

- A.等于
- B.大于
- C.小于
- D.大于或等于

答案：A

第 98 题.互换方案的基本过程有()。

- I 建立成本和融资渠道矩阵
- II 确定各方比较优势
- III 划分互换利益



扫码下载 233 网校题库
一刷就过，千万人掌上题库！

IV 为互换定价，即确定互换合约中各方应支付的利率

A. I、II、III、IV

B. I、II、III

C. I、II、IV

D. II、III、IV

答案：A

第 99 题.在合伙型基金中，()负责出资，并以出资额为限，承担有限()责任。

A.普通合伙人;追偿

B.普通合伙人;连带

C.有限合伙人;追偿

D.有限合伙人;连带

答案：D

第 100 题.下列关于资本市场线的说法中，正确的是()。

I 根据 CAPM 的假定，所有投资者都具有相同的预期，那么所有投资者都会得到同样的有效前沿

II 每一位投资者都将以无风险资产和市场投资组合来构造适合自己需求的最优投资组合

III 每个投资者持有的风险投资组合是不同的，而市场投资组合是所有投资者持有的风险资产组合的加总

IV 资本市场线实际上指出了有效投资组合风险与预期收益率之间的关系，提供了衡量有效投资组合风险的方法

A. I、II、III、IV

B. I、II、III

C. I、II、IV

D. II、III、IV

答案：C

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！