

2019年6月基金从业《证券投资基金基础知识》更新部分真题及答案,有多套试卷,每个人试题可能不一样,仅供参考!

1.关于货币市场工具的特点,以下表述错误的是( )。

- A. 风险较低
- B. 流动性一般
- C. 期限不超过1年
- D. 是债务契约

【答案】B

2. 以下关于私募股权二级市场投资战略,说法错误的是( )。

- A.存在不同的交易形式,结构上也存在不同的设计形式
- B.组织通常以合伙人的形式
- C.周期短、风险小、流动性强
- D.转让有限合伙人权益份额时,新的有限合伙人不仅可能承担权利,也可能承担尚未履行的出资义务

【答案】C

3. 以下不动产投资工具中,作为一种资产证券化产品,可以采取上市的方式在证券交易所挂牌交易的是( )。

- A.房地产有限合伙
- B.房地产权益基金
- C.房地产投资信托基金
- D.房地产股份公司

【答案】C

4. 在基金运作过程中,下列费用中应由基金投资者自己承担,不能从基金资产中列支的是( )。

- A.基金合同生效后的信息披露费用
- B.销售服务费
- C.基金份额持有人大会费用
- D.基金转换费

【答案】D

5.某机构投资者7月4日买入A基金10,000份,成交价格1.1元,卖出B基金5,000份,成交价格2元,不考虑其他交易费用的前提下,该机构投资者当日需支付的印花税是( )元。

- A.10
- B.0
- C.11
- D.21

【答案】B

6.下列关于贴现现金流估值法(discounted cash flow, DCF)的描述错误的是( )。



- A.根据 DCF 估值法, 债券的价格与贴现率成反比, 与票息呈正比  
B.DCF 估值法计算出的债券公平价格, 还取决于模型估值时不同的参数设置及数据选取的人为因素  
C.DCF 估值法只适用于债券, 因为债券存续期内有稳定且确定的现金流  
D.根据 DCF 估值法, 债券公平价格取决于两大因素: 债券的现金流和贴现率

【答案】 C

7. 基金利润分配对投资者的影响是( )。  
A.基金份额净值下降, 投资者的利益没有实际影响  
B.基金份额净值上升, 投资者的利益没有实际影响  
C.基金份额净值下降, 投资者受损失  
D.基金份额净值上升, 投资者获益

【答案】 A

8. 关于事前风险指标的特点, 以下说法正确的是( )。  
A.评价组合的历史表现通常使用事后指标, 而事前指标无法预测投资组合的未来绩效  
B.事前风险指标通常用来评价一个组合在历史上的表现和风险情况  
C.方差是典型的事后指标, 不能作为事前指标使用  
D.事前指标只与组合在当前的持仓状况相关, 与组合在历史上的持仓无关

【答案】 D

- 9.一般股票型基金投资者的赎回金额由( )进行计算得出。  
A. 基金托管人  
B. 证券清算机构  
C. 基金份额登记机  
D. 无需计算, 由投资者直接提交

【答案】 C

- 10.假设其他因素不变, 当企业用现金购买存货时, 流动资产( )。  
A.增加  
B.无法确定增减  
C.减少  
D.不变

【答案】 D

11. 关于浮动利率债券, 以下表述错误的是( )。  
A.其利息在每个支付期都会根据基准利率的变化重新设置  
B.有些浮动利率债券的条款中利率存在浮动上限  
C.浮动利率债券的利率组成为基准利率加上基差(可正可负)  
D.其利息参考基准利率的变化, 随市场利率的波动而波动

【答案】 C



12. 下列说法错误的是( )。

- A. 期权合约和远期合约以及期货合约的不同在于其损益的不对称性
- B. 远期、期货和大部分互换合约有时被称作远期承诺
- C. 信用违约互换合约使买方可以对卖方行使某种权利
- D. 期权合约和利率互换合约被称为单边合约

【答案】 D

13. 某证券投资基金某期利息收入 100 元, 投资收益 180,000 元, 公允价值变动损益为零, 管理费 200 元, 交易费用 200 元, 以上为该基金当期全部损益, 则该基金本期利润是( )。

- A. 180,100 元
- B. 99,700 元
- C. 180,500 元
- D. 179,700 元

【答案】 D

14. 下列关于优先股的表述中, 错误的是( )。

- A. 在公司盈利和剩余财产的分配顺序上, 优先股股东优于普通股股东
- B. 优先股具有股权和债权双重属性
- C. 优先股的股息率是随市场变化的
- D. 优先股一般无表决权

【答案】 C

15. 资本市场线上的投资组合包括无风险资产和( )。

- A. 杠杆投资组合
- B. 任意风险资产
- C. 市场投资组合
- D. 可行投资组合

【答案】 A

16. 采用被动投资策略的投资者, 通常( )。

- A. 试图利用技术预测市场总体走势调整股票组合
- B. 认为市场并非完全有效
- C. 尝试利用基本面分析找出被低估或高估的股票
- D. 通过跟踪指数获得基准指数的回报

【答案】 D

17. 2014 年上市公司 W 销售收入为 10 亿元, 总资产收益率 5%, 净资产收益率 10%, 销售利润率 20%。则 W 公司 2014 年的总资产为( )。

- A. 10 亿元
- B. 40 亿元



C.20 亿元

D.5 亿元

【答案】 B

18 关于股票投资风险与收益的关系, 以下表述错误的是( )。

A.股票预期收益率越高, 它的已实现收益也越高

B.股票的风险与收益是相伴而生的

C.股票的风险与收益呈正相关性

D.风险相同的股票, 其实际收益也可能不同

【答案】 A

19. 按照持有人权利的性质来分类, 可以将权证分为( )。

A.美式权证、欧式权证和百慕大权证

B.认股权证和备兑权证

C.股权类权证、债权类权证和其他权证

D.认购权证和认沽权证

【答案】 D

20. 某投资机构的组合为 60%的 A 股和 40%的短期债券, 其计划在未来一段时间内将组合调整为 50%A 股、10%短期债券、20%私募股权投资、10%房地产和 10%大豆期货。请问此项组合调整最可能的目的是( )。

A.增加流动性

B.分散风险

C.提升信息透明度

D.提高估值准确度

【答案】 B

21. 以下关于战术资产配置的说法中, 错误的是( )。

A.战术资产配置增强组合回报率的有效性已经得到了实践的证明, 不存在争议 B.战术资产配置通过择时, 对投资组合各特定资产类别的权重配置进行调整, 但对战略资产配置的偏离往往限制在一定范围内

B.战术资产配置没有再次估计投资者偏好与风险承受能力或投资目标是否发生了变化

D.战术资产配置是在遵守战略资产配置确定的大类资产比例基础上进行的

【答案】 A

22. 关于期货市场的作用, 以下表述错误的是( )

A.期货交易需要对大量信息进行加工, 故期货交易形成的未来价格信号具有滞后性

B.提供分散、转移价格风险的工具, 有助于稳定国民经济

C.农产品期货市场有助于减缓农产品价格波动对农业发展的不利影响

D.期货交易所形成的未来价格信号能反映多种生产要素在未来一定时期的变化趋势



考证就上233网校APP

报考指导、学习视频、免费题库一手掌握

【答案】A

23. 下列属于由非系统风险造成证券价格变化的是( )。

- A.人民币大幅贬值致资本外流严重, 中国债市下跌
- B.英国退欧致英国股市大跌
- C.美联储议息会议宣布不加息且下调加息预期后, 美股大涨
- D.印度某制药公司宣布取得某生物技术专利并开始投产, 其股价大涨

【答案】D

24. 要评估单位系统风险下的超额收益率, 应该采用的风险调整后收益指标为( )。

- A.特雷诺比率
- B.信息比率
- C.詹森
- D.夏普比率

【答案】A

25. 债券市场所说的年利率都是指( )。

- A.名义利率
- B.保值贴补率
- C.实际利率
- D.通货膨胀率

【答案】A

26. 关于资产收益之间的相关性对投资组合的影响, 以下说法正确的是( )。

- A.影响投资组合的预期收益率, 不影响投资组合的风险
- B.既不影响投资组合的预期收益率, 也不影响投资组合的风险
- C.既影响投资组合的预期收益率, 又影响投资组合的风险
- D.不影响投资组合的预期收益率, 影响投资组合的风险

【答案】D

27. 任何一个行业都要经历一个生命周期, 以下不属于行业生命周期的是( )

- A.初创期
- B.成熟期
- C.衰退期
- D.过渡期

【答案】D

28. 根据上交所的交易规则, 以下目前不能采用大宗交易方式的是( )。

- A.B 股
- B.ETF 申赎
- C.国债买断式回购



考证就上233网校APP

报考指导、学习视频、免费题库一手掌握

D.优先股

【答案】D

29. 从资产最高价格到接下来最低价格的损失是指( )。

- A.最大回撤
- B.非系统性风险
- C.下行风险
- D.市场风险

【答案】A

30. 以下指标中, 既是计算投资者申购基金份额、赎回资金金额的基础, 又是评价基金投资业绩基础的为( )。

- A.基金资产净值
- B.基金总资产
- C.基金总负债
- D.基金份额净值

【答案】D

31. 同业拆借对金融市场具有重要意义, 主要表现在( )。

- A.同业拆借的资金用于缓解金融机构的中长期资金紧张
- B.同业拆借市场不能提高资金拆出方的获利能力
- C.同业拆借利率作为市场的基准利率, 是衡量市场流动性的重要指标
- D.同业拆借市场的存在必然增加金融机构的流动性风险

【答案】C

32. 政策性金融债的发行人通常不包括( )。

- A.中国农业银行
- B.国家开发银行
- C.中国进出口银行
- D.中国农业发展银行

【答案】A

33. 以下不属于按照持有人收益方式分类的债券品种是( )。

- A.免税债券
- B.固定利率债券
- C.浮动利率债券
- D.永续债券

【答案】D

34. 下列条款中, 属于给予发行人额外权利的嵌入条款是( )。

- A.回售条款



考证就上233网校APP

报考指导、学习视频、免费题库一手掌握

B.承销条款

C.赎回条款

D.转换条款

【答案】 C

35.企业破产时, 债权人能获得的最多支付是( )。

A.债券面值、利息、股息

B.债券面值

C.债券面值、利息、股息、分红

D.债券面值、利息

【答案】 D

36.某债券的到期时间为 1.25 年, 则其麦考利久期( )。

A.无法判断和到期时间的关系

B.不可能等于 1.25 年

C.小于或者等于 1.25 年

D.一定大于 1.25 年

【答案】 C

37. 基金托管人对基金管理人的估值原则或程序有异议时, 应( )。

A.报告中国证监会

B.以基金管理公司的估值原则和程序为准, 因为基金管理人是估值责任人, 基金托管人根据基金管理人的估值原则和程序复核基金资产净值以及基金份额申购、赎回价格

C.保有质询基金管理公司做出合理解释的权利

D.有义务要求基金管理公司做出合理解释

【答案】 D

38.目前, 我国银行间市场债券结算业务类型不包括( )。

A.利率互换

B.现券业务

C.买断式回购业务

D.债券借贷

【答案】 A

39.于可行投资组合集, 下列说法错误的是( )。

A.如投资者要求投资风险不高于某给定水平, 可行投资组合集的范围会缩小

B.加入无风险资产能够极大地扩展可行投资组合集

C.卖空限制将缩小可行投资组合集的范围

D.由两个风险资产组成的投资组合, 其可行投资组合集是一个扇形

【答案】 D



考证就上233网校APP

报考指导、学习视频、免费题库一手掌握

40.基金公司的投资管理部门主要包括( )。

I.投资决策委员会

II.投资部

III.研究部

IV.交易部

A.I、II

B.I、II、III

C.I、II、IV

D.I、II、III、IV

【答案】D

扫码进入 233 网校基金从业资料包获取更多备考冲刺资料!

资料包地址: <https://v.233.com/webApp/Datum/datuminfolist?classId=1004>



添加微信号: ks233wx9, 拉你入基金从业微信交流群, 分享更多经验!!!



考证就上233网校APP

报考指导、学习视频、免费题库一手掌握