

2019年10月基金从业科目二《证券投资基金基础知识》真题,来源网友反馈,仅供参考!

1、以下关于半强有效市场的表述中,错误的是()。

- A.市场半强有效意味着价格对信息的反应是瞬间完成的
- B.如果市场是半强有效的,市场参与者就不可能从任何公开信息中获取超额收益,这意味着基本面分析方法是无效的
- C.在价格对信息吸收的过程中,价格围绕新的均衡价格上下波动
- D.证券价格不仅已经反映历史价格信息,而且反映当前所有与公司证券有关的公开有效信息

【参考答案】A

2、某基金年度平均收益率为20%,假设无风险收益率为3%(年化),该基金的年化波动率为25%,贝塔系数为0.85,则该基金的特雷诺比率为()。

- A.0.2
- B.0.68
- C.0.8
- D.0.25

【参考答案】A

3、下列选项中,不属于我国现行场内证券交易结算原则的是()。

- A.见款付券原则
- B.货银对付原则
- C.法人结算原则
- D.分级结算原则

【参考答案】A

4、以下选项中不属于货币市场基金的特点的是()。

- A 资本安全性高
- B 购买限额低
- C 收益稳定
- D 流动性相对较弱

【参考答案】D

5、假设某只基金只持有四只股票,数量分别50万股、60万股、80万股、100万股,每股的收盘价分别为15元、20元、35元、5元,银行存款为1000万元,应交税费为1750万元,已售出的基金份额为3000万份。假设基金没有其他资产和负债,则基金份额净值为()。

- A.1.83元
- B.1.33元
- C.1.17元
- D.1.50元



【参考答案】 D

6、投资者以自有资金 10 万元和融资款 5 万元全额买入目标证券,目标证券价格为 100 元/股,所选择的证券公司的融资年利率为 8.6%。半年后目标证券价格为 104 元/股,该投资者选择卖出 1500 股并偿还融资款。不考虑分红和交易费用,该投资者的投资收益为()。

- A.1700 元
- B.3850 元
- C.4000 元
- D.6000 元

【参考答案】 B

7、关于资产负债表基本作用,以下表述错误的是()。

- A 资产负债表上的资源为分析收入来源性质及其稳定性提供了基础
- B 资产负债表的资产项可以揭示企业资金的占用情况
- C 资产负债表列出了企业占有资源的数量和性质
- D 资产负债表可以反映企业未来产生经营现金流的能力

【参考答案】 D

8、关于系统性风险和非系统性风险,以下表述错误的是()。

- A 经济增长和政治因素都属于引发非系统性风险的因素
- B 系统性风险发生时所有资产均或多或少受到影响
- C 系统性风险又称为市场风险
- D 非系统性风险主要包括违约风险、经营风险、流动性风险

【参考答案】 A

9、关于股票估值方法,以下模型和方法属于内在价值法的是()。

- A 市盈率模型
- B 经济附加值模型
- C 市销率模型
- D 企业价值倍数

【参考答案】 B

10、关于投资债券的风险,以下表述正确的是()。

- I、只要债券发行人没有违约,投资人就不会因为信用风险遭受损失
- II、浮动利率债券的利息是浮动的,因此不会面临通货膨胀风险
- III、固定利率债券的价格与利率呈反向变动关系
- IV、买卖价差越小,债券的流动性越高

- A II、III、IV
- B III、IV
- C I、II、III



D II、IV

【参考答案】B

11、票面金额为 100 元的 2 年期债券，年票息率 6%，当期市场价格为 95 元，则该债券的到期收益率()。

- A 5.5%
- B 6.5%
- C 10.1%
- D 8.8%

【参考答案】D

12、票息率为 5% 的 3 年期债券，市场价格为 100 元，到期收益率为 5%，麦考利久期为 2.86 年，如果该债券的到期收益率下降至 4.9%，那么该债券的价格变动为()。

- A 上涨 0.495 元
- B 下跌 0.272 元
- C 上涨 0.272 元
- D 下跌 0.495 元

【参考答案】C

13、看跌期权买入开仓，收益情况为()。

- A 损失有限，收益无限
- B 损失无限，收益无限
- C 损失无限，收益有限
- D 损失有限，收益有限

【参考答案】D

14、基金公司投资交易流程包含的环节有()。

- I、形成投资策略
- II、构建投资组合和执行交易指令
- III、风险控制
- IV、绩效评估与组合调整

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

【参考答案】A

15、如果证券价格中已经反映了影响价格的全部信息，那么该证券市场被称为()。

- A 半强有效市场
- B 无效市场



考证就上233网校APP

报考指导、学习视频、免费题库一手掌握

C 强有效市场

D 弱有效市场

【参考答案】C

16、关于资本市场理论, 以下表述错误的是()。

A 单个资产的风险溢价与市场投资组合 M 的风险溢价和该资产的 β 系数成比例

B 市场组合处于有效前沿, 但不同投资者的市场组合点不同

C CAPM 模型中的前提假设可以归结为所有投资者一致和市场有效这两条

D β 系数衡量资产收益率相对市场组合收益率变化的敏感程度

【参考答案】B

17、基金业绩评价应考虑的因素包括()。

I.基金规模

II.时间区间

III.综合考虑风险和收益

A I、II、III

B I、III

C II、III

D I、II

【参考答案】A

18、关于名义利率, 以下说法正确的是()。

A 名义利率包含了通货膨胀率的变化

B 名义利率不会低于实际利率

C 名义利率已经剔除了物价的影响

D 名义利率已设定到期日的零票息债券到期收益率

【参考答案】A

19、已知企业 A 的资产负债率为 0.4, 则其负债权益比为()。

A 1.67

B 0.67

C 1.5

D 2.5

【参考答案】B

【参考答案】D

20、关于房地产投资信托, 以下表述错误的是()。

A 房地产投资信托具有较大的通货膨胀风险, 通货膨胀会带来严重的不利影响

B 房地产投资信托是经证券化的房地产投资, 可在交易市场上交易, 具有较强的流动性

C 与房地产公司股票相比, 房地产投资信托的波动性更低



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 上市的房地产信托须定期进行信息披露, 降低了信息不对称程度

【参考答案】A

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