

考试证券投资基金基础知识-8 试题及答案

1. 同一期间内，投资于国内市场的基金 A 贝塔系数为 0.85，基金 B 的贝塔系数为 1.1，以下说法正确的是（ ）。[单选题] *

基金 A 的净值随市场的变动幅度比基金 B 小

基金 A 和基金 B 的净值变动方向相反

基金 A 和基金 B 的净值变动方向与市场不一致(正确答案)

基金 A 的净值随市场的变动幅度比基金 B 大

答案解析：贝塔系数大于 0 时，该投资组合的价格变动方向与市场一致；贝塔系数小于 0 时，该投资组合的价格变动方向与市场相反。贝塔系数等于 1 时，该投资组合的价格变动幅度与市场一致。贝塔系数大于 1 时，该投资组合的价格变动幅度比市场更大。贝塔系数小于 1（大于 0）时，该投资组合的价格变动幅度比市场小。

2. 以下不属于影响股票价格的行业因素的是（ ）。[单选题] *

管理层质量

行业或产业竞争结构

行业持续性

抗外部冲击能力(正确答案)

答案解析：行业因素，又称产业因素，影响某一特定行业或产业中所有上市公司的股票价格。这些因素包括行业生命周期、行业景气度、行业法令措施以及其他影响行业价值面的因素。

3. 以下关于全国银行间债券市场交易的固定收益品种估值的说法正确的是（ ）。

[单选题] *

含权的固定收益品种，以第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值(正确答案)

不含权的固定收益品种，可以第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价

估值

不含权的固定收益品种，可以第三方估值机构提供的相应品种推荐估值净价进行估值

对银行间市场未上市，且第三方估值机构未提供估值价格的债券，在发行利率与二级市场利率不存在明显差异、未上市期间市场利率没有发生大的变动的情况下，按成本估值

答案解析：不含权的固定收益品种，以第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值。含权的固定收益品种，以第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价进行估值。含投资人回售权的固定收益品种，回售登记期截止日（含当日）后未行使回售权的按照长待偿期所对应的价格进行估值。对银行间市场未上市，且第三方估值机构未提供估值价格的债券，在发行利率与二级市场利率不存在明显差异、未上市期间市场利率没有发生大的变动的情况下，按成本估值。

4. 每日价格最大波动限制的目的是（）。[单选题]*

寻找交易对手(正确答案)

防止价格波动幅度过大造成交易者重大损失

维持期货价格稳定

防范期货市场风险

答案解析：每日价格最大波动限制，也称为每日涨跌停板制度，即期货合约在一个交易日中的交易价格波动不得高于规定的涨跌幅度或者低于规定的涨跌幅度，超过该涨跌幅度的报价将被视为无效，不能成交。涨跌停板一般是以合约上一交易日的结算价为基准确定的。该条款的规定在于防止价格波动幅度过大造成交易者重大损失。

5. 关于托管资产的场内资金清算模式，下列表述不正确的是（）。[单选题]*

托管人结算模式是指托管资产场内交易形成的交收资金由托管人作为结算参与人与中国证券登记结算有限责任公司进行净额交收，然后由托管人负责与托管资产组合进行二级清算的模式(正确答案)

托管人结算模式的前提条件是托管资产进行场内交易须通过专用交易单元

单一客户资产管理计划、信托计划采用券商结算模式

当托管资产的场内交易不能通过专用交易单元进行时，只能采用托管人结算模式

答案解析：由于相关交易制度或交易成本等因素的限制，当托管资产的场内交易不能通过专用交易单元进行时，只能采用券商结算模式（QFII 基金除外），证券公司作为托管资产的经纪人，代理进行场内交易、提供证券经纪服务。

6. 下列关于开放式基金的利润分配，说法不正确的是（）。[单选题] *

我国开放式基金按规定需在基金合同中约定每年基金利润分配的最多次数和基金利润分配的最低比例(正确答案)

基金收益分配后基金份额净值不能高于面值

开放式基金有现金分红和分红再投资转换为基金份额两种分红方式

现金分红方式是开放式基金分配的最普遍形式

答案解析：我国开放式基金要求基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

7. 假定某基金的总资产为 35 亿元，总负债为 5 亿元，发行在外的基金份额总数为 30 亿份，那么其基金份额净值为（）元。[单选题] *

1

1.16

1.23

1.35(正确答案)

答案解析：基金份额净值=（基金资产-基金负债）/基金总份额=（35-5）/30=1（元）。

8. 假设某投资者持有 5000 份基金 A，当前的基金份额净值为 1.4 元，对该基金按 1：1.4 的比例进行拆分操作后，对应的基金资产为（）元。[单选题] *

3571

5000(正确答案)

7000

9800

以上内容仅为本文档的试下载部分，为可阅读页数的一半内容。如要下载或阅读全文，请访问：<https://d.book118.com/218127013043007006>