

2009年5月证券投资基金知识考前练习题二证券从业资格考试
PDF转换可能丢失图片或格式，建议阅读原文

https://www.100test.com/kao_ti2020/645/2021_2022_2009_E5_B9_B45_E6_9C_c33_645734.htm

单项选择题 1. 积极的债券组合管理策略：应急免疫和骑乘收益率曲线 如果要求债券组合的最低价值为200万元，剩余时间为2年，市场利率8%，则应急免疫的触发点为（ ）。 A. 16万元 B. 100万元 C. 171.47万元 D. 233.28万元

【答案】 C 【解析】 应急免疫是一种债券组合投资策略，该策略的触发点是使投资者停止采取积极的投资策略转而采用利率免疫策略的投资组合的价值，以保证期末获得最低价值。应急免疫的触发点=200÷[(1+8%)²]=171.47（万元）。 5. 现代投资理论的产生与发展 对威廉夏普

（William Sharpe）资本资产定价模型（CAPM）的检验性提出质疑的是（ ）。 A. 法玛（Fama） B. 马科维兹

（Markowitz） C. 詹森（Jensen） D. 罗斯（Ross） 【答案

】 D 6. 股票投资组合目标 证券X的期望收益率为12%，标准差为20%；证券Y期望收益率为15%，标准差为27%。如果两个证券的相关系数为0.7，则它们的协方差为（ ）。 A. 0.038 B. 0.070 C. 0.018 D. 0.054 【答案】 A 7. 定期信息披露 目前，我国封闭式证券投资基金（ ）披露一次信息。 A. 每日 B. 每周 C. 每个月 D. 每个季度 【答案】 B 8. 基金投资监督依据及结果处理方式 在我国，1只基金投资于国家债券的比例不得低于基金资产净值的（ ）。 A. 10% B. 20% C. 30% D. 40% 【答案】 B 9. 股票投资风格分类 鉴于小型股票的流动性偏低，因此，从长期来看，小型资本股票的回报率（ ）大型资本股票。 A. 大于 B. 小于 C. 等于 D. 可能大于也可

能小于 【答案】 A 【解析】 小型股票的流动性偏低，意味着必须对小型股票的投资者进行流动性补偿，从而小型股票的回报率高于大型资本股票的回报率。 10. 基金份额持有人大会的决定事项 依照《证券投资基金法》的规定，提高基金管理人报酬应当召开基金份额持有人大会审议，并取得参加大会的基金份额持有人所表决权的（ ）以上通过。 A. 30% B. 50% C. 1/3 D. 2/3 【答案】 B

编辑推荐：好资料快收藏，百考试题证券站 百考试题证券在线模拟系统，海量题库2009年证券从业考试远程辅导，热招中！百考试题特别推荐：2009年证券投资基金每日一练4月试题汇总2009年证券投资基金每日一练3月试题汇总2009年证券投资基金每日一练2月试题汇总2009年证券投资基金每日一练1月试题汇总 100Test 下载频道开通，各类考试题目直接下载。详细请访问

www.100test.com