

## 2019 年 4 月证券投资基金考试真题及答案 2

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

参考答案：B

12、对于不含期权的债券，当债券收益率分别上升和下降相同单位时，以下说法正确的是（）

- A.债券价格会随之同向变动，且价格上升幅度等于下降幅度
- B.债券价格会随之反向变动，且价格上升幅度大于下降幅度
- C.债券价格会随之反向变动，且价格上升幅度等于下降幅度
- D.债券价格会随之反向变动，且价格上升幅度小于下降幅度

参考答案：B

13、关于主动投资和被动投资，以下表述正确的是（）

- A.被动投资通过市场择时获得超额收益
- B.主动投资在强有效市场比弱有效市场更有优势
- C.主动投资和被动投资是完全对立的
- D.被动投资试图复制某一业绩基准，主动投资试图跑赢市场

参考答案：D

14、如果基于月度收益计算得到的下行标准差为 8%，那么年化下行标准差为（）

- A.3.32%
- B.2.31%
- C.27.71%
- D.96%

参考答案：C

15、关于另类投资，以下表述正确的是（）

- A.期货、期权为衍生工具，属于典型的另类投资的范畴
- B.目前我国还没出现境内公募另类投资基金
- C.艺术品和收藏品的投资价值建立在艺术家声望和销售记录的条件之上，属于另类投资
- D.另类投资意味着创新投资，所以房地产、大宗商品投资这类有悠久历史的投资不属于另类投资

参考答案：C

16、某 QDII 基金委托境外投资顾问进行境外证券投资，该投资顾问同时还受托管理其他境外对冲基金，投资顾问在其投资及运营过程中发生的下列行为符合相关规定的是（）

- A.经过内部决策流程，提交了买入股票 A 的投资建议
- B.在尽职调查过程中，披露委托人 QDII 基金的详细信息
- C.在同事处理对冲基金和 QDII 基金的投资建议时，优先处理 QDII 基金的投资建议
- D.经过内部讨论，同意不披露某重大利益冲突事项

参考答案：A

17、境内机构投资者开展境外证券投资业务时，可以选择境外资产托管人员负责境外资产托管业务。关于境外资产托管人所需满足的条件，以下表述正确的是（）

- A.在中国大陆以外的国家或地区设立，最近一个会计年度实收资本不少于 2 亿美元或等值货币，或托管规模不少于 2000 亿美元或等值货币
- B.在中国大陆以外的国家或地区设立，最近一个会计年度实收资本不少于 10 亿美元或等值货币，或托管规模不少于 1000 亿美元或等值货币
- C.在中国大陆设立，最近一个会计年度实收资本不少于 20 亿美元或等值货币，或托管规模不少于 2000 亿美元或等值货币
- D.在中国大陆设立，最近一个会计年度实收资本不少于 10 亿美元或等值货币，或托管规模不少于 1000 亿美元或等值货币

参考答案：B

18、关于私募股权投资采取的主要退出机制，以下表述错误的是（）。

- A.破产清算
- B.借壳上市
- C.大宗交易
- D.首次公开发行

参考答案：C

19、按照现行的股息红利差别化个人所得税政策，投资者持有期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的股票取得的股息红利，适用的个人所得税税率为（）。

- A.50%
- B.20%
- C.30%
- D.60%

参考答案：B

20、某 2 年期债券的面值为 1000 元，票面利率为 6%，每年付息一次，现在市场收益为 8%，其市场价格为 964.29 元，则麦考利久期为（）。

- A.1.94 年
- B.2.04 年
- C.1.75 年
- D.2 年

参考答案：A