基金从业资格考试高频考点汇总

年月类

1868 英国世界上第 1 只证券基金：海外及殖民地政府信托
1924 美国世界第 1 只开放式公司型基金：马萨诸塞投资信托基金
1933 美国《证券法》
1934 美国《证券交易法》
1940 美国《投资公司法》《投资顾问法》
1957 年标普指数编制
1992.6 深圳人行批准当时最大封基：天骥基金
1992.11 央总行批准的第 1 家投资基金：淄博基金，1 亿元
1993.8 月第 1 只上市交易封闭式基金：淄博基金
1995CFA 协会筹备全球投资业绩标准委员会
1997《证券投资基金管理暂行办法》发布，此前的基金叫：老基金
1998.3 南方、国泰基金成立，发行规模 20 亿元的基金开元、基金国泰
2000 证监会发《开放式证券投资基金试点办法》
2001.8 证券业协会基金公会成立
2001.9 第 1 只开基华安创新
2002.2《证券投资基金内控意见》出台
2002.12 首家中外合资基金公司成立：国联安基金公司
2003.10《证券投资基金法》通过，2014.6.1 实施
2003.12 我国第 1 只货基
2004 证券业协会证券投资基金委员会成立
2005 资产证券化试点，2007 扩大试点
2006.11 第 1 只 QDII 发行：华安国际配置基金
2007 首例基金从业人员利用未公开信息交易被发行
2010 短期融资券启动
2012.6.6 证券投资基金业协会成立
2013.6 修订后的《证券投资基金法》实施
2013.9 国债期货合约推出
基金国际化趋势始于 20 世纪 80 年代

时限类

基金重大事项临时公告：2 日内
基金季报：季末 15 个工作日
基金年报：年末 90 日
基金定期报告备案：披露后第 2 个工作日
证监会收到验资报告及备案材料后书面确认备案完成、基金合同生效：3 个工作日
登记材料齐备后，基金业协会私募办结登记：20 个工作日
证监会受理基金公司变更股东、控制人：60 日决定
证监会受理基金募集申请后：6 个月决定
巨额赎回延期支付：3 个工作日内公告
基金宣传材料发布后：5 个工作日备案

召开份额持有人大会：提前 30 日公告
托管人职责终止 6 个月内新选任
ETF 建仓期：3 个月
开基募集期：3 个月
基金合同生效后：次日公告
公布招募书、基金合同：发售前 3 日
基金申赎申请后：3 个工作日管理人确认有效性
基金验资：募集期届满后 10 日内
基金不能成立返款给投资者：30 日内
基金申购：T+2 确认，下日可赎回
基金申购成功后： T+1 登记办理
基金申购成功后：T+2 可赎回
基金申购款：T+2 日到基金银行账户
基金赎回款：T+3 日从基金银行账户划出
LOF 从 TA 转入证券登记系统后：T+2 可卖出或赎回
QDII 放开申赎前至少：每周公告一次净值
QDII 份额净值：至少每周计算披露 1 次
QDII 涉及衍生品份额净值：每个工作日披露
QFII 额度获批后注入资金：6 个月内
QFII 本金锁定期：3 个月
开基延期赎回不超：20 工作日
质押式回购：最长 1 年
债券远期交易日到结算日：不超 365 天
大额可转让存单最短期限：14 天
买断式回购最长期限：91 天
银行间债券市场现券交易结算日：T+0 和 T+1
融资融券开户资格：18 个月，50 万
连续几年没托管业务取消托管资格：3 年
证监会领导离职几年内不得到与原工作直接相关机构任职：3 年
证监会一般工作人员离职几年内不得到与原工作直接相关机构任职：2 年
基金董监高应有：3 年以上相关工作经历
基金经营机构客户身份资料及交易记录保存：5 年
基金经营机构客户交易终端信息及开户资料电子化信息保存：20 年
基金销售机构客户身份资料及交易记录保存：15 年
货币基金不得投资剩余期限高于：397 天的债券
货币基金投资组合平均剩余期限不高于：180 天

资格类

基金公司注册资本：1 亿元
基金主要法人股东净资产：2 亿元
基金主要自然人股东金融资产：3000 万元，10 年资管经验
持股 5%以上基金非主要法人股东净资产：5000 万元
持股 5%以上基金非主要自然人股东金融资产：1000 万元，5 年资管经验
基金申请 QDII 条件：2 年基金业务，2 亿净资产，200 亿管理资产

券商申请 QDII 条件：1 年资管业务，8 亿净资本，20 亿管理资产，净资本占净资产 70%
QDII 境外托管人条件：10 亿美元实收资本，1000 亿美元托管资产
QDII 境外投顾条件：5 年投资管理，100 亿美元管理证券资产
合资基金公司境外股东条件：3 年无处罚，3 亿元实收资本
QFII 托管人条件：80 亿元实收资本
QFII 设立条件：
资管机构：2 年资管业务，5 亿美元管理证券资产
保险公司：成立 2 年，5 亿美元持有证券资产
其他机构：成立 2 年，5 亿美元持有或管理证券资产
证券公司：5 年证券业务，5 亿美元净资产，50 亿美元管理证券资产
商业银行：10 年银行业务，3 亿美元一级资本，50 亿美元管理证券资产
私募合格投资者：
机构：1000 万净资产，100 万起
个人：300 万金融资产 or 近三年年均收入 50 万， 100 万起
基金经理资格：3 年无处罚，3 年证管经历，从业资格，法律考试
基金公司到港设机构：1 年无处罚

之最类
最大对冲基金：布里奇沃特
最大大宗商品管理公司：贝莱德
最大 PE：高盛
最大基础设施投资公司：麦格里
最大不动产投资公司：世邦魏理仕
最先出现的金融期货：外汇期货
按名义金额计算，交易量最大衍生工具：互换合约
最难预测趋势：短期趋势
欧洲最大资产管理中心：英国
全球第一基金分销中心：卢森堡

门槛类
开放式基金最小规模：2 亿元
封基最小募集规模：核准额 80%
QDII 认购门槛：1000 元
ETF 申赎门槛：30 万元
基金净值计算错误报告门槛：0.25%
基金净值计算错误报告并公告门槛：0.5%
合资基金公司外资持股：49%以下
合资基金公司港资持股：50%以上可
深交所 A 股佣金起点：5 元
QFII 持个股限制：10%以下
分级基金合并募集认申购门槛：5 万元
分级基金分开募集 B 类认申购门槛：5 万元
股基认购费：不超 1.5%
B 股无过户费，有结算费：0.05%，不超 500 港元

货基销售服务费率：0.25%
纽交所石油期货最小交易单位：1000 桶
芝加哥小麦最小交易单位：5000 蒲

计算类

复利终值：FV=PV*(1+i)^n
复利现值：PV=FV/（1+i）^n
单利利息=PV*i*t
远期利率：f12=（1+s2）^2/（1+s1）--1
净认购额=认购金额/（1+认购费率）
认购份额=（净认购额+认购利息）/份额面值
赎回总额=赎回数量*份额净值
赎回费用=赎回总额*赎回费率
赎回金额=赎回总额-赎回费用
折溢价率=（二级市场价-份额净值）/份额净值
ETF 份额折算比例=（基金资产净值/基金总份额）/（指数收盘值*1%或 0.1%）
ETF 折算后份额=原持有份额* ETF 份额折算比例
除权除息价=（前收盘价-现金红利+配股价*股份变动比例）/（1+股份变动比例）
标的证券除权除息后权证行权价=原行权价*标的证券除权除息价/标的证券除权除息前价
标的证券除权后权证行权比例=原行权比例*标的证券除权前价/标的证券除权价
标的证券除息后，行权比例不变
基金管理费、托管费、销售服务费=（前一日基金资产净值*年费率）/当年实际天数
保本基金风险资产投资额=放大倍数*安全垫=放大倍数*（投资组合现时净值-价值底线）
权益乘数（杠杆比率）=总资产/所有者权益
负债权益比（产权比率）=负债/所有者权益
修正久期=久期/（1+到期收益率）
修正久期衡量市场利率变动时，债券价格的变动：△P/P=-Dmod△y
维持担保比例=（现金+市值）/（融资买入额+融券卖出数量*市价+利息费用）
贝塔系数：βp=ρp，m*（σp/σm）
基金股票换手率=（期间基金股票交易量/2）/期间基金平均资产净值
时间加权收益率=（1+r1）（1+r2）……（1+rn）-1
几何平均收益率=（∏（1+ri））^(1/n)-1

扫描二维码立即下载 基金从业考试刷题神器