1. 截至目前，规模以上量化机构中超额收益最高的公司为

A、明汯 B、幻方 C、九坤 **D、启林**

1. 以下板块中，2020年11月表现最弱的是

A、消费 B、金融 C、有色 **D、医药**

1. 以下那个是现在中证500的主力合约代码

**A、IC2012** B、IF2012 C、IC2101 D、IF2101

1. 贴水收敛后，假设市场与政策环境并没有变化，最有效的操作为

A、赎回 B、观望  **C、加仓** D、以上都不是

5、2020年7月，打新收益最高的板块是

A、主板 B、中小板 **C、科创板** D、创业板

1. 夏普比率和卡玛比例哪个更关注回撤

A、夏普 **B、卡玛**

1. 以下那种特征对基本面因子最友好

A、券商涨其他不涨 B、汽车涨其他不涨

**C、食品饮料涨其他不涨** D、有色涨其他不涨

1. 当某月股指期货年化贴水为50%，在目前的水平下，哪种策略是最合适的

**A、买入股指期货合约** B、认购指数增强产品

C、购买ETF基金 D、购买雪球结构产品

1. 个股涨跌分布的离散程度与以下哪个策略的超额收益相关性最高？

A、基本面多因子 B、高频量价

C、T0 **D、量化选股**

1. 以下哪项不是现在AB款产品规模降低的原因

A、打新收益降低 B、Alpha收益降低

1. 新股发行放缓 D、资金成本提升

10、今年量化私募的管理规模较去年上涨的幅度为？

A、50% B、100%

**C、150%** D、200%