

全国 2015 年 10 月高等教育自学考试

证券投资与管理试题

课程代码:00075

请考生按规定用笔将所有试题的答案涂、写在答题纸上。

选择题部分

注意事项:

1. 答题前,考生务必将自己的考试课程名称、姓名、准考证号用黑色字迹的签字笔或钢笔填写在答题纸规定的位置上。
2. 每小题选出答案后,用 2B 铅笔把答题纸上对应题目的答案标号涂黑。如需改动,用橡皮擦干净后,再选涂其他答案标号。不能答在试题卷上。

一、单项选择题 (本大题共 20 小题, 每小题 1 分, 共 20 分)

在每小题列出的四个备选项中只有一个是符合题目要求的, 请将其选出并将“答题纸”的相应代码涂黑。未涂、错涂或多涂均无分。

1. “证券是资本所有权或债券的书面证明”描述的是证券的
A. 权益性
B. 流通性
C. 机会性
D. 风险性
2. 上海证券交易所成立于
A. 1990 年
B. 1991 年
C. 1992 年
D. 1993 年
3. 下列关系中正确的是
A. 注册资本>发行股本>实收股本
B. 实收股本>注册资本>发行股本
C. 注册资本>实收股本>发行股本
D. 发行股本>注册资本>实收股本
4. 债券具有较强的变现能力是指债券特征中的
A. 收益性
B. 安全性
C. 偿还性
D. 流动性
5. 下列关于可转换债券的说法错误的是
A. 在特定条件下可以转换为普通股
B. 既有债权性, 又有股权性
C. 有规定的利率和还款期限
D. 转换成股票之前可以参与公司的经营决策
6. 下列关于契约型基金的说法正确的是
A. 契约型基金的结构中通常包括三个当事人: 委托人、受托人和受益人
B. 信托法不是契约型基金的设立依据
C. 契约型基金依据公司章程来经营财产
D. 契约型基金是指按公司法组成的基金, 其本身就是投资公司

7. 我国的证券管理机构是
- A. 中国人民银行
B. 中国证券监督管理委员会
C. 财政部
D. 证券业协会
8. 我国最高等级的债券是
- A. A 级
B. AA 级
C. AAA 级
D. AAAA 级
9. 在证券承销的几种方式中, 风险最小的是
- A. 代销
B. 全额包销
C. 余额包销
D. 分销
10. 证券的发行市场又称
- A. 一级市场
B. 二级市场
C. 三级市场
D. 柜台交易市场
11. 根据我国目前证券结算的规定, A 股的交收时间安排为
- A. T+0
B. T+1
C. T+2
D. T+3
12. 下列关于股票发行注册制的说法错误的是
- A. 美国实行双重注册制
B. 注册制下, 证券主管机构无权对证券本身做出价值判断
C. 注册制下, 发行人的营业性质、财力和发展前景均不作为发行审核要件
D. 注册制下, 发行人的发行权由审核部门以法定方式授予
13. 以下哪个指标属于营运能力分析指标?
- A. 资产负债率
B. 存货周转率
C. 总资产报酬率
D. 股东权益收益率
14. MACD 的组成部分包括
- A. DIF 和 DEA
B. DIF 和 KDJ
C. DEA 和 KDJ
D. KDJ 和 MA
15. 根据 KDJ 指标的规则, 出现下列哪种情况时买入信号最为可靠?
- A. KD 超过 80%
B. KD 超过 90%
C. 右侧相交 K 上穿 D
D. 左侧相交 K 上穿 D
16. 甲企业 2014 年 6 月 30 日的流动资产净额为 1000 万元, 流动负债为 500 万元, 存货为 300 万元, 流动比率为
- A. 1
B. 1.5
C. 2
D. 3
17. 下列哪一项属于非系统性风险?
- A. 宏观经济风险
B. 财务风险
C. 汇率风险
D. 社会、政治风险

18. 投资组合由 A, B 两种证券构成, 证券 A 在投资组合中的权重为 40%, 证券 B 在投资组合中权重为 60%。A, B 两种证券的预期收益率及概率分布如下:

预期收益率		概率
证券 A	证券 B	
16%	20%	25%
12%	14%	50%
8%	4%	25%

则该投资组合的预期收益率为

- A. 10.8%
 - B. 12.4%
 - C. 12.6%
 - D. 14.2%
19. 资本市场线的斜率代表
- A. 期望收益和风险的比例关系
 - B. 无风险利率
 - C. 单个证券的系统性风险
 - D. 随机因素产生的剩余收益
20. 证券上市程序的第二步是
- A. 申请
 - B. 退市
 - C. 上市
 - D. 审核

二、多项选择题(本大题共 5 小题, 每小题 2 分, 共 10 分)

在每小题列出的五个备选项中至少有两个是符合题目要求的, 请将其代码选出并将“答题纸”的相应代码涂黑。未涂、错涂、多涂或少涂均无分。

21. 股份公司按股东所负的责任不同, 可以分为
- A. 无限责任公司
 - B. 股份有限公司
 - C. 有限责任公司
 - D. 两合公司
 - E. 公开招股公司
22. 债券的票面要素包括
- A. 面值
 - B. 还本和付息的期限
 - C. 票面利率
 - D. 赎回条款
 - E. 偿债基金
23. 普通股股东享有的权利包括
- A. 投票选举权
 - B. 收益分配权
 - C. 剩余财产分配权
 - D. 优先认购新股权
 - E. 领取股息优先权
24. 契约型基金的当事人包括
- A. 委托人
 - B. 受托人
 - C. 受益人
 - D. 投资公司
 - E. 承销公司
25. 证券上市对发行公司的好处包括
- A. 有利于提高公司证券的流动性
 - B. 有利于获取创业资本
 - C. 有利于提高公司知名度
 - D. 有利于公司资本大众化
 - E. 有利于确定公司的市场价值

非选择题部分

注意事项：

用黑色字迹的签字笔或钢笔将答案写在答题纸上,不能答在试题卷上。

三、名词解释题（本大题共 4 小题，每小题 3 分，共 12 分）

26. 期货交易
27. 专家经纪人
28. 风险评估
29. β 系数

四、简答题（本大题共 5 小题，每小题 6 分，共 30 分）

30. 简述股票发行价格的确定方法。
31. 简述证券市场的功能。
32. 简述国债的特点。
33. 简述投资基金的优点。
34. 简述我国证券业自律组织的构成。

五、论述题（本大题共 2 小题，每小题 14 分，共 28 分）

35. 试述股票价格指数的一般计算方法及编制股票价格指数的意义。
36. 试述道氏理论的原理和基本观点。