

全国 2018 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。在每小题列出的备选项中只有一项是最符合题目要求的,请将其选出。

1. 股份有限公司的常设权力机构是

- A. 股东大会
- B. 董事会
- C. 监事会
- D. 工会

2. 我国债券信用评级的最高等级是

- A. A 级
- B. AA 级
- C. AAA 级
- D. AAAA 级

3. 在股票市场上一定会被执行的交易指令是

- A. 限价委托指令
- B. 市价委托指令
- C. 止损委托指令
- D. 限价止损委托指令

4. 一般来说,风险最低的债券是

- A. 金融债券
- B. 企业债券
- C. 国债
- D. 地方政府债券

5. 按照是否可以赎回,证券投资基金可以分为

- A. 开放式与封闭式
- B. 公司型与契约型
- C. 成长型与收益型
- D. 公募型与私募型

6. 证券经纪商的收入来源是

- A. 佣金
- B. 税金
- C. 利息
- D. 买卖价差

7. 我国目前的股票发行制度是
- A. 注册制
 - B. 核准制
 - C. 审批制
 - D. 备案制
8. 我国贴现国债的发行通常采用
- A. 收益率招标
 - B. 缴款日招标
 - C. 认购规模招标
 - D. 价格招标
9. 根据我国《公司法》的规定，股票的发行不能采用
- A. 折价发行
 - B. 溢价发行
 - C. 平价发行
 - D. 中间价发行
10. 融资融券是指
- A. 远期交易
 - B. 信用交易
 - C. 期货交易
 - D. 期权交易
11. 中央银行调整基准利率对证券投资带来的风险是
- A. 系统风险
 - B. 非系统风险
 - C. 财务风险
 - D. 流动性风险
12. 用来测算股价与股价移动平均线之间偏离程度的技术指标是
- A. 相对强弱指数
 - B. 乖离率
 - C. 威廉指标
 - D. 随机指数
13. 一个处于行业生命周期初创阶段的公司具有
- A. 很高的稳定性
 - B. 很高的市场增长率
 - C. 很高的利润
 - D. 很高的经营风险
14. 股票的内在价值主要取决于
- A. 公司盈利能力
 - B. 投资者情绪
 - C. 股票供需
 - D. 股价指数
15. 在现代投资组合理论中，常用的风险度量工具是证券收益率的
- A. 期望
 - B. 标准差
 - C. 偏度
 - D. 峰度
16. 以下哪一项是行为金融学中过度自信的表现？
- A. 代表性偏差
 - B. 自我成就归因偏差
 - C. 频繁交易效应
 - D. 有效性偏差
17. 有效市场假说的支持者主张
- A. 主动的投资策略
 - B. 择股与择时
 - C. 频繁买卖股票
 - D. 投资于指数基金

18. 根据资本资产定价模型，进取型股票的 β
- A. 等于 0
 - B. 小于 1
 - C. 等于 1
 - D. 大于 1
19. 根据资本资产定价模型，在资本市场均衡条件下，所有的证券都会落在
- A. 资本市场线上
 - B. 资本市场线上方
 - C. 证券市场线上
 - D. 证券市场线上方
20. 在我国，对证券市场进行监管的机构是
- A. 中国人民银行
 - B. 财政部
 - C. 中国证券业协会
 - D. 中国证券监督管理委员会

二、多项选择题：本大题共 5 小题，每小题 2 分，共 10 分。在每小题列出的备选项中至少有两项是符合题目要求的，请将其选出，错选、多选或少选均无分。

21. 我国综合类证券公司的主要业务包括
- A. 证券经纪
 - B. 证券自营
 - C. 吸收存款
 - D. 证券承销
 - E. 融资融券
22. 下列金融工具中属于衍生证券的有
- A. 金融期货
 - B. 金融期权
 - C. 认股权证
 - D. 优先股
 - E. 浮动利率债券
23. 下列财务指标中反映公司营运能力的是
- A. 资产负债率
 - B. 存货周转率
 - C. 总资产收益率
 - D. 净资产收益率
 - E. 应收帐款周转率
24. 下列属于技术分析中反转形态的是
- A. 上升三角形
 - B. 矩形
 - C. 头肩顶
 - D. 双头
 - E. 圆弧顶
25. 证券市场信息披露义务的特性有
- A. 单向性
 - B. 公正性
 - C. 公开性
 - D. 强制性
 - E. 时间的持续性

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. 可转换债券
27. 市盈率
28. 看涨期权
29. 内幕信息

四、简答题:本大题共4小题,每小题6分,共24分。

30. 简述发行市场与流通市场的关系。
31. 简述证券投资基金的特点。
32. 简述行为金融学的特征。
33. 简述证券投资的风险管理方法。

五、计算题:本大题共1小题,8分。

34. 假设你投资一只股票两年,初始投资额为100万元,第一年年末股票市值为50万元,第二年年末股票市值为100万元,试计算该项投资的算术平均年收益率和几何平均年收益率。

六、论述题:本大题共2小题,每小题13分,共26分。

35. 结合实际分析投资机构化趋势对证券市场的影响。
36. 试对比分析证券投资的基本分析法与技术分析法。