

全国 2019 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 16 小题,每小题 1 分,共 16 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. 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. 场外市场

2. 证券公司经纪业务的收入来源是

- A. 佣金
- B. 税金
- C. 利息
- D. 买卖价差

3. 我国沪、深证券交易的组织形式是

- A. 公司制
- B. 会员制
- C. 注册制
- D. 股份制

4. 目前我国证券交易所规定的融资保证金比率不得低于

- A. 30%
- B. 50%
- C. 130%
- D. 150%

5. 我国债券的最高信用等级是

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

6. 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. 既有股权性也有债权性
- C. 有规定的利率和还款期限
- D. 转换为股票前可以参与公司经营管理

7. 以下基金中风险最低的是
- A. 货币市场基金 B. 债券基金
C. 股票基金 D. 平衡基金
8. 国际金融市场上大多数浮动利率的基础利率是
- A. 伦敦银行同业拆放利率 B. 东京银行同业拆放利率
C. 美国联邦基金利率 D. 巴林银行同业拆放利率
9. 为了对你持有的长期国债进行套期保值, 你应该
- A. 购买国债期货 B. 出售沪深 300 指数期货
C. 出售国债期货 D. 在现货市场出售长期国债
10. 某公司股票面值为 1 元, 发行价为 1 元, 该股票的发行行为
- A. 平价发行 B. 折价发行
C. 溢价发行 D. 中间价发行
11. 采购经理指数 (PMI) 反映经济强弱的分界点是
- A. 20% B. 50%
C. 80% D. 100%
12. 收盘价、开盘价、最高价与最低价四价相等时形成的 K 线是
- A. 一字型线 B. T 字型线
C. 阳线 D. 阴线
13. 根据 CAPM, 资产价格的决定因素是资产的
- A. 个别风险 B. 系统风险
C. 非系统风险 D. 总风险
14. 能够用来估计证券预期收益率的是
- A. 算术平均收益率 B. 几何平均收益率
C. 复合收益率 D. 时间权重收益率
15. 证券市场线的斜率代表
- A. 剩余收益 B. 无风险利率
C. 单个证券的系统性风险 D. 市场组合的风险溢价
16. 证券投资组合被动管理的常用策略是
- A. 买入股票基金 B. 买入债券基金
C. 购买指数基金 D. 购买价值低估的股票

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。

17. 股份公司的设立方式包括
- A. 合伙设立 B. 发起设立 C. 募集设立
D. 契约设立 E. 股份设立
18. 债券的发行主体有
- A. 中央政府 B. 地方政府 C. 金融机构
D. 企业 E. 家庭
19. 根据分析对象的不同，技术分析方法可以分为
- A. K 线分析 B. 切线分析 C. 形态分析
D. 指标分析 E. 财务分析
20. 以下公司属于周期型行业的有
- A. 食品公司 B. 制药公司 C. 珠宝公司
D. 自来水公司 E. 航空公司
21. 在行为金融学中，过度自信的表现有
- A. 频繁交易效应 B. 事后聪明偏差 C. 一月效应
D. 损失厌恶 E. 分散化不足

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。

22. 优先股
23. 贴现债券
24. 购买力风险
25. 沉没成本

四、简答题：本大题共 5 小题，每小题 6 分，共 30 分。

26. 简述指数型基金的优点。
27. 简述期货与期权在盈亏方面的区别。
28. 简述技术分析中趋势线的作用。
29. 简述有效市场的三种形式。
30. 简述证券市场信息披露义务的特点。

五、计算题：本大题共 1 小题，8 分。

31. A 公司 2018 年 12 月 31 日的资产负债表显示：流动资产为 40000 万元，其中，应收帐款为 4000 万元，存货为 10000 万元；流动负债为 20000 万元。请计算该公司的流动比率与速动比率。

六、论述题：本大题共 2 小题，每小题 12 分，共 24 分。

32. 试述股票发行注册制与核准制的区别。

33. 试述我国多层次资本市场的构成。