

全国 2021 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

1. 请考生按规定用笔将所有试题的答案涂、写在答题纸上。
2. 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。

选择题部分

注意事项:

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. 我国沪、深证券交易所的执行机构是
A. 会员大会
B. 理事会
C. 股东大会
D. 董事会
2. 下列债券中不规定票面利率的是
A. 浮动利率债券
B. 附息债券
C. 贴现债券
D. 累进利率债券
3. 下列债券中价格波动幅度最大的是
A. 5 年期零息债券
B. 票面利率为 5%的 5 年期附息债券
C. 票面利率为 5%的 3 年期附息债券
D. 票面利率为 7%的 5 年期附息债券
4. 某公司发行的可转换债券面值为 100 元,转换价格为 20 元,该公司股票的市场价格为 25 元,则转换比例为
A. 0.2
B. 0.25
C. 4
D. 5
5. 投资者卖出一份协定价格为 80 元的看涨期权,期权费为 2 元,到期日标的股票价格为 85 元,该投资者在到期日的收益为
A. -5 元
B. -3 元
C. 3 元
D. 5 元

六、论述题：本大题共 2 小题，每小题 13 分，共 26 分。

35. 试述基本分析法与技术分析法的区别。

36. 试述证券市场的集中监管模式。