

2023年10月高等教育自学考试全国统一命题考试

证券投资与管理

(课程代码 00075)

注意事项:

1. 本试卷分为两部分, 第一部分为选择题, 第二部分为非选择题。
2. 应考者必须按试题顺序在答题卡(纸)指定位置上作答, 答在试卷上无效。
3. 涂写部分、画图部分必须使用2B铅笔, 书写部分必须使用黑色字迹签字笔。

第一部分 选择题

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. 下列金融工具中流动性最强的是
A. 3月期国债
B. 5年期公司债
C. 10年期国债
D. 股票
2. 我国沪、深证券交易所的组织形式是
A. 公司制
B. 会员制
C. 注册制
D. 股份制
3. 我国付息国债的发行通常采用
A. 价格招标
B. 缴款日招标
C. 收益率招标
D. 认购规模招标
4. 如果封闭式基金的投资者想要变现, 必须
A. 按基金净值平价出售给发行人
B. 按基金净值折价出售给发行人
C. 按基金净值溢价出售给发行人
D. 通过经纪人将基金份额出售给其他投资者
5. 某股票基金当日的资产为45,000,000元, 负债为1,700,000元。该基金当日的基金份额为20,000,000份, 则其基金单位净值为
A. 1.81元
B. 2.165元
C. 2.25元
D. 2.5元

6. 投资者买入一份协定价格为60元的欧式看涨期权, 期权费为2元, 标的股票在到期日的市场价格为65元, 该投资者的收益为
A. -5元
B. -3元
C. 3元
D. 5元
7. 债券信用评级是评估和计量债券的
A. 违约风险
B. 市场风险
C. 利率风险
D. 购买力风险
8. 为了对你持有的股票组合进行套期保值, 你应该
A. 购买上证50ETF
B. 出售沪深300指数期货
C. 购买沪深300指数期货
D. 在现货市场出售该股票组合
9. 我国的5年期国债期货属于
A. 货币衍生工具
B. 利率衍生工具
C. 股权类衍生工具
D. 信用衍生工具
10. 降低风险的同时也放弃了获得额外收益的可能性, 这种行为是
A. 投机
B. 套利
C. 保险
D. 套期保值
11. 假设你向证券公司借入10,000股SA公司的股票卖出, SA股票的市场价格为50元/股, 券商要求的初始保证金比率为60%, 你账户中的自有资金为
A. 20万元
B. 30万元
C. 35万元
D. 50万元
12. 我国规定股票的发行必须采用
A. 直接发行
B. 间接发行
C. 公募发行
D. 私募发行
13. 下列指标中能够反映某一时期生产领域价格变动水平的是
A. CPI
B. PMI
C. PPI
D. KDI
14. 某公司今年的净利润为2800万元, 利息费用为1600万元, 支付的所得税为1200万元, 该公司的利息保障倍数为
A. 1.75
B. 2.5
C. 2.75
D. 3.5
15. 收盘价、开盘价与最低价三价相等时形成的K线是
A. T字型线
B. 倒T字型线
C. 十字阳线
D. 十字阴线

