

2024年10月高等教育自学考试全国统一考试

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. 发行市场又叫
 - A. 二级市场
 - B. 流通市场
 - C. 一级市场
 - D. 货币市场
2. 股份公司破产清算时, 下列权益人中最先得到清偿的是
 - A. 优先股持有者
 - B. 债券持有者
 - C. 个人股持有者
 - D. 法人股持有者
3. 证券经纪商的收入来源是
 - A. 买卖价差
 - B. 税金
 - C. 股利和利息
 - D. 佣金
4. 下列金融资产中风险最低的是
 - A. 地方政府债券
 - B. 国债
 - C. 企业债券
 - D. 股票
5. 在其著名论文《证券组合选择》中提出现代证券组合理论的美国经济学家是
 - A. 马柯威茨
 - B. 夏普
 - C. 林特
 - D. 罗尔
6. 向少数特定的投资者发行的证券是
 - A. 公募证券
 - B. 私募证券
 - C. 基金证券
 - D. 非上市证券
7. 甲公司2010年6月30日, 流动资产净额600万元, 流动负债净额是320万元, 存货为300万元。则其流动比率为
 - A. 0.94
 - B. 1
 - C. 1.875
 - D. 2
8. 债券具有较强的变现能力, 这体现了债券的
 - A. 收益性
 - B. 流动性
 - C. 安全性
 - D. 偿还性
9. 目前对我国证券市场主管的单位是
 - A. 中国证券监督管理委员会
 - B. 中国保险监督管理委员会
 - C. 中国银行业监督管理委员会
 - D. 中国人民银行
10. 在我国, 有资格成为基金托管人的是
 - A. 证券公司
 - B. 信托投资公司
 - C. 商业银行
 - D. 基金公司
11. 我国证券行业的自律性组织是
 - A. 上海证券交易所
 - B. 深圳证券交易所
 - C. 中国证券业协会
 - D. 中国证券监督管理委员会
12. 下列属于技术分析方法是
 - A. 公司财务分析
 - B. 宏观经济分析
 - C. 道氏理论分析
 - D. 行业分析
13. 投资基金起源于
 - A. 英国
 - B. 美国
 - C. 德国
 - D. 日本
14. 通过银行获得贷款的融资方式属于
 - A. 直接融资
 - B. 间接融资
 - C. 信用融资
 - D. 担保融资
15. 下列属于持续整理形态的是
 - A. 圆弧顶形态
 - B. 头肩顶形态
 - C. 旗形形态
 - D. 双重底形态
16. 某股票的市场价格为12元, 每股税后利润为0.5元, 则该股票的市盈率是
 - A. 6
 - B. 12
 - C. 20
 - D. 24

17. 某投资者预测甲股票的收益率有两种结果分别为 10%和-5%，两种收益率出现的概率分别为 60%和 40%，甲股票的期望收益率为
- A. 2.5% B. -2%
C. 6.5% D. 4%
18. 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%
19. 兼有债权和股权双重特征的金融工具是
- A. 优先股票 B. 可赎回债券
C. 可转换债券 D. 金融债券
20. 资本资产定价模型所要解决的问题是
- A. 如何测定证券组合及单个证券的期望收益与风险间的关系
B. 如何确定证券的市场价格
C. 如何选择最优证券组合
D. 如何确定证券的市场价格与其内在价值之间的差异

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. 根据《公司法》，股份有限公司可以通过
- A. 直接设立 B. 委托设立
C. 发起设立 D. 募集设立
E. 代理设立
22. 我国规定对信息持续披露的内容包括
- A. 中期报告 B. 年度报告
C. 财务报告 D. 季度报告
E. 会议报告
23. 相对于现货交易，期货交易的特殊作用表现在
- A. 有利于投资者转移价格风险 B. 有利于投机者的投机获利
C. 有利于价格发现 D. 有利于资金周转
E. 能够增加社会财富
24. 证券交易完整的交易程序一般包括
- A. 开户 B. 委托
C. 成交 D. 清算交割
E. 过户

25. 契约型基金的当事人主要有
- A. 投资者 B. 承销人
C. 投资公司 D. 管理人
E. 托管人

第二部分 非选择题

三、名词解释题：本大题共 4 小题，每小题 3 分，共 12 分。

26. 弱式有效市场
27. 羊群效应
28. 风险
29. 证券投资基金

四、简答题：本大题共 4 小题，每小题 6 分，共 24 分。

30. 简述有价证券的特征。
31. 简述注册制和核准制的对比。
32. 简述构建证券投资组合的原因。
33. 简述金融衍生工具的基本特征。

五、计算题：本大题共 1 小题，每小题 8 分，共 8 分。计算结果保留至小数点后二位。

34. 预期某公司股票每年可以获得每股股息 0.2 元，市场利率为 5%，那么该股票的理论价格应该是多少？如果市场利率上升到 10%，那么该股票价格是上升还是下跌？

六、论述题：本大题共 2 小题，每小题 13 分，共 26 分。

35. 论述股票发行价格的影响因素。
36. 论述如何进行公司的盈利能力分析。