

2019年4月贵州省高等教育自学考试

## 金融市场学 试卷

(课程代码 00077)

(考试时间: 150分钟)

答卷注意事项:

1. 请考生必须在答题卡上作答。答在试卷和草稿纸上的无效。
2. 第一部分为选择题。必须对应试卷上的题号使用 2B 铅笔将“答题卡”的相应代码涂黑。
3. 第二部分为非选择题。必须按试题顺序注明大、小题号(大题号只写一次), 使用 0.5 毫米黑色字迹签字笔作答。
4. 必须在答题区内作答, 超出答题区无效。

### 第一部分 选择题 (共 30 分)

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. 与金融资产的期限性成反比的是  
A. 金融资产的收益性      B. 金融资产的风险性  
C. 金融资产的流动性      D. 金融资产的收益性和风险性
2. 金融市场的宏观经济功能不包括  
A. 分配功能      B. 财富功能  
C. 调节功能      D. 反映功能
3. 下列不属于货币市场的是  
A. 同业拆借市场      B. 回购市场  
C. 票据市场      D. 股票市场
4. 按拆借资金的保障方式, 同业拆借市场划分为  
A. 有形拆借市场和无形拆借市场      B. 有担保拆借市场和无担保拆借市场  
C. 头寸拆借市场和同业借贷市场      D. 半天期拆借市场和隔夜拆借市场

5. 票据持票人在票据背面签名将该票据权利转让给受让人的行为是  
A. 出票      B. 背书  
C. 承兑      D. 贴现
6. 信用等级处于 AAA 与 BBB 之间的债券一般被划分为  
A. 投资级别      B. 投机级别  
C. 金边债券      D. 垃圾债券
7. 股票市场的首要功能是  
A. 募集资金      B. 引导资金合理流动  
C. 优化资源配置      D. 风险定价
8. 在中国境外注册、在香港上市但主要业务在中国内地的股票是  
A. 国有股      B. 外资股  
C. 蓝筹股      D. 红筹股
9. 股票发行方式按发行过程划分, 可分为  
A. 公募发行和私募发行      B. 直接发行和间接发行  
C. 场内发行和场外发行      D. 招标发行和非招标发行
10. 投资基金的特点不包括  
A. 利益共享      B. 集中投资  
C. 专业管理      D. 独立托管
11. 当今世界最大的外汇交易市场是  
A. 伦敦外汇市场      B. 纽约外汇市场  
C. 巴黎外汇市场      D. 东京外汇市场
12. 从计算角度, 汇率分为  
A. 基准汇率和交叉汇率      B. 固定汇率和浮动汇率  
C. 即期汇率和远期汇率      D. 买入汇率、卖出汇率和中间汇率
13. 黄金市场的功能不包括  
A. 价格发现      B. 资源配置  
C. 投资避险      D. 资产定价
14. 关于期权交易双方的风险, 正确的是  
A. 买方损失有限, 收益无限      B. 卖方损失有限, 收益无限  
C. 买方收益有限, 损失无限      D. 卖方损失、收益均无限
15. 下列离岸金融市场中, 发展模式为内外一体型的是  
A. 伦敦离岸金融市场      B. 纽约离岸金融市场  
C. 东京离岸金融市场      D. 新加坡离岸金融市场

16. 市场价格已经充分反映出所有过去证券价格信息(成交价、成交量等)的市场被称为  
A. 强式有效市场      B. 半强式有效市场  
C. 弱式有效市场      D. 无效市场
17. 关于  $\beta$  系数, 下列说法错误的是  
A.  $\beta$  系数是衡量证券承担系统风险水平的指数  
B.  $\beta$  系数的绝对数值越大, 表明证券承担的系统风险越大  
C.  $\beta$  系数是计量单个证券随市场移动趋势变动的指标  
D.  $\beta$  系数衡量的风险可以通过证券投资组合分散掉
18. 在我国, 负责监管证券业市场的是  
A. 中国人民银行      B. 银保监会  
C. 证监会      D. 外汇管理局
19. 从绝对量上看, 货币时间价值是使用货币的  
A. 沉没成本      B. 机会成本  
C. 边际成本      D. 单位成本
20. 在具备合法性的前提下, 金融市场监管主体拥有行使职权的自由性, 即自由裁量权。这体现的是金融市场监管的  
A. 依法监管原则      B. 合理性原则  
C. 协调性原则      D. 效率原则
- 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. 银行承兑汇票具有哪些特征  
A. 安全性强      B. 流动性大  
C. 灵活性好      D. 有追索权  
E. 违约风险大
22. 按投资基金组织形式不同, 基金可分为  
A. 契约型基金      B. 成长型基金  
C. 公司型基金      D. 收入型基金  
E. 平衡型基金
23. 股票流通市场的交易方式包括  
A. 信汇      B. 现货交易  
C. 掉期交易      D. 信用交易  
E. 期货交易

24. 技术分析的理论基础是建立在哪三个假设之上的  
A. 历史会重演      B. 零和博弈  
C. 市场行为包含一切信息      D. 价格沿趋势移动  
E. 信息传递
25. 离岸金融市场的特点包括  
A. 金融监管较少      B. 市场范围广阔  
C. 具有批发性      D. 银行间市场地位突出  
E. 完全国际化
- 三、名词解释题: 本大题共 4 小题, 每小题 3 分, 共 12 分。**
26. SHIBOR  
27. 债券  
28. 私募基金  
29. 现场检查监管

- 四、简答题: 本大题共 5 小题, 每小题 6 分, 共 30 分。**
30. 简述金融市场的构成要素。  
31. 简要分析票据的作用。  
32. 简述外汇市场的层次。  
33. 黄金具有哪些属性?  
34. 简述金融期货合约的特点。

- 五、论述题: 本大题共 2 小题, 每小题 14 分, 共 28 分。**
35. 论述影响债券定价的因素。  
36. 试分析创业板市场的风险。