

2023 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. 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

24. 下列关于预期收益率的说法正确的有
- A. 预期收益率是投资者要求的最低收益率
 - B. 预期收益率是最可能实现的收益率
 - C. 预期收益率是未来各种状态收益率的加权平均
 - D. 预期收益率可以用算术平均收益率来估计
 - E. 预期收益率可以用收益率历史数据的样本均值来估计
25. 如果经济周期处于繁荣阶段, 你应该投资
- 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

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。

- 26. 开放式基金
- 27. 远期交易
- 28. 市净率
- 29. 心理账户

四、简答题: 本大题共 4 小题, 每小题 6 分, 共 24 分。

- 30. 简述证券场内交易市场的特点。
- 31. 简述优先股的特点。
- 32. 简述基本分析的理论基础。
- 33. 简述移动平均线的买入判断法则。

五、计算题: 本题 8 分。计算结果保留至小数点后二位。

- 34. 某公司 1 年前发行了可转换公司债券, 面值为 100 元, 初始转股价格为 10 元, 该公司当年的股利分配政策为每 10 股派现金股利 2 元, 每 10 股送 5 股红股, 该公司股票前一天的收盘价为 12 元/股, 今天是除权除息日, 请计算该公司可转换债券的初始转股比例和最新转股比例。

六、论述题: 本大题共 2 小题, 每小题 13 分, 共 26 分。

- 35. 试述股票发行核准制与注册制的区别。
- 36. 试述资本资产定价模型与套利定价理论的区别与联系。