

绝密★启用前

2016 年 4 月高等教育自学考试全国统一命题考试

证券投资与管理 试卷

(课程代码 00075)

本试卷共 8 页, 满分 100 分; 考试时间 150 分钟。

总分		题号	一	二	三	四	五
核分人		题分	20	10	12	30	28
复查人		得分					

得分	评卷人	复查人

一、单项选择题(本大题共 20 小题, 每小题 1 分, 共 20 分)
在每小题列出的四个备选项中只有一个是符合题目要求的, 请将其代码填写在题后的括号内。错选、多选或未选均无分。

1. 上海证券交易所成立于 【 】
A. 1989 年 B. 1990 年
C. 1991 年 D. 1992 年
2. 证券的发行市场又叫 【 】
A. 二级市场 B. 一级市场
C. 流通市场 D. 货币市场
3. 按股东享有权利和承担风险大小的不同, 股票可以分为 【 】
A. 普通股和记名股票 B. 优先股和有票面金额股票
C. 普通股和优先股 D. 记名股票和不记名股票
4. 股份公司的总经理的任命权归属于 【 】
A. 股东大会 B. 董事会
C. 监事会 D. 薪酬委员会
5. 将债券划分为信用债券和担保债券的标准是 【 】
A. 按照债券是否记名划分 B. 按照债券可否提前赎回划分
C. 按照债券期限的长短划分 D. 按照债券有无担保划分
6. 以下哪一项不是投资基金的优点? 【 】
A. 分散投资 B. 分散风险
C. 能以最低费用享受专家服务 D. 投资基金收益凭证流动性高
7. 将投资基金分为开放式基金和封闭型基金的依据是 【 】
A. 按照基金的经营策略 B. 按照基金是否可以赎回
C. 按照基金的投资对象 D. 按照基金的组织形式

8. 相比于公募发行, 私募发行的有利之处在于 【 】
A. 发行数量大 B. 有利于提高发行人的社会信誉
C. 发行费用低 D. 流通性较强
9. 下列关于中国证监会的说法错误的是 【 】
A. 证监局不是中国证监会的派出机构
B. 中国证监会是国务院直属机构
C. 中国证监会是全国证券、期货市场的主管部门
D. 研究、拟定证券和期货市场的方针政策是中国证监会的主要职责之一
10. 目前, 股票清算采取 【 】
A. T+0 制度 B. T+1 制度
C. T+2 制度 D. T+3 制度
11. “由发行公司首先算出参考价格, 然后在此基础上与承销商协商确定”这句话描述的是股票发行价格确定方法中的 【 】
A. 议价法 B. 竞价法
C. 拟定价 D. 定价法
12. 在道琼斯指数的构建中, 纽交所上市的股票按行业分成三大类。以下哪一类不属于道琼斯分类法的范畴? 【 】
A. 工业 B. 运输业
C. 公用事业 D. 商业
13. 我国最高信用评级债券所使用的级别符号是 【 】
A. A B. AA
C. AAA D. AAAA
14. 甲公司的流动资产为 900 万元, 流动负债为 300 万元, 存货为 300 万元。则甲公司的速动比率为 【 】
A. 1 B. 2
C. 3 D. 4
15. 某 K 线形态由两根 K 线组成, 第一根 K 线为一强劲阳线, 第二根 K 线为一跳空高开低走的阴线, 其特征表现为当日开盘价比上日最高价要高, 其阴线的实体部分深入到第一根阳线实体中去, 该形态是 【 】
A. “穿头破足”形态 B. “乌云盖顶”形态
C. “曙光初现”形态 D. “包容”形态
16. 证券投资风险管理的程序中, 第一步是 【 】
A. 选择风险管理技术 B. 风险评价
C. 风险评估 D. 风险识别
17. 下列选项中属于非系统性风险的是 【 】
A. 宏观经济风险 B. 财务风险
C. 汇率风险 D. 社会、政治风险

18. 投资组合由 A, B 两种证券构成, 证券 A 在投资组合中的权重为 40%, 证券 B 在投资组合中的权重为 60%。A, B 两种证券的预期收益率及概率分布如下:

预期收益率		概率
证券 A	证券 B	
16%	20%	25%
12%	14%	50%
8%	4%	25%

则该投资组合的预期收益率为 【 】

- A. 10.8%

B. 12.4%
- C. 12.6%

D. 14.2%
19. 证券市场监管对象包括 【 】
- A. 投资者、筹资者和商业银行

B. 投资者和国务院
- C. 国务院和法院

D. 商业银行和法院
20. 证券市场监管原则不包括 【 】
- A. 公开原则

B. 规范原则
- C. 公平原则

D. 公正原则

二、多项选择题(本大题共 5 小题, 每小题 2 分, 共 10 分)
在每小题列出的五个备选项中至少有两个是符合题目要求的, 请将其代码填写在题后的括号内。错选、多选、少选或未选均无分。

21. 证券市场和一般商品市场相比, 具有以下哪些特征? 【 】

A. 交易对象和交易目的不同

B. 价格的决定因素不同

C. 参与的交易者不同

D. 市场风险和流动性不同

E. 市场的功能和作用不同

22. 债券的票面要素有 【 】

A. 面值

B. 还本和付息期限

C. 票面利率

D. 赎回条款

E. 偿债基金

23. 证券投资基金的创立和运行涉及的各方有 【 】

A. 投资人

B. 监管机构

C. 发起人

D. 管理人

E. 托管人

24. 我国的证券业自律组织包括 【 】

A. 证监会

B. 证券交易所

C. 证券登记结算公司

D. 证券业协会

E. 会计师事务所

25. 上市公司信息持续披露的内容包括 【 】

A. 月度报告

B. 中期报告

C. 年度报告

D. 临时报告

E. 招股说明书

证券投资与管理试卷第 3 页 (共 8 页)

得分	评卷人	复查人

三、名词解释题(本大题共 4 小题, 每小题 3 分, 共 12 分)

26. 证券发行市场

27. 经济周期

28. 注册制

29. 招股说明书

得分	评卷人	复查人

四、简答题(本大题共 5 小题, 每小题 6 分, 共 30 分)

30. 简述证券发行人的构成。

证券投资与管理试卷第 4 页 (共 8 页)

密封线内不准答题

31. 简述股份有限公司的组织结构。

32. 简述契约型基金和公司型基金的主要区别。

33. 简述证券经营机构的作用。

34. 简述证券交易的方式。

得 分	评卷人	复查人

五、论述题（本大题共 2 小题，每小题 14 分，共 28 分）

35. 试述证券投资风险评估的原则及方法。

36. 试述国债的特点及其发行的目的。