

证券投资与管理 试卷

(课程代码 00075)

本试卷分为两部分,满分100分;考试时间为150分钟。

第一部分为选择题,1页至4页,共4页。应考者必须按试题顺序在“答题卡”上按要求填涂,答在试卷上无效。

第二部分为非选择题,4页至5页,共2页。应考者必须按试题顺序在“答题卡”上作答,答在试卷上无效。

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)

在每小题列出的四个备选项中只有一个是符合题目要求的,请将其选出并将“答题卡”的相应代码涂黑。错涂、多涂或未涂均无分。

1. 证券发行人包括
A. 个人和企业
B. 企业、金融机构和政府部门
C. 个人和金融机构
D. 个人和政府部门
2. 上海证券交易所成立于
A. 1990年
B. 1991年
C. 1992年
D. 1993年
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. 债券具有较强的变现能力是指债券特征中的
A. 收益性
B. 安全性
C. 偿还性
D. 流动性
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. 下列关于契约型基金的说法正确的是
A. 契约型基金的结构中通常包括三个当事人:委托人、受托人和受益人
B. 信托法不是契约型基金的设立依据
C. 契约型基金依据公司章程来经营财产
D. 契约型基金是指按公司法组成的基金,其本身就是投资公司
7. 将投资基金分为开放型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. 证券的代销、包销期最长不得超过
A. 70天
B. 80天
C. 90天
D. 100天
9. 下列关于中国证监会的说法错误的是
A. 证券监管办公室不是中国证监会的派出机构
B. 中国证监会是国务院的直属机构
C. 中国证监会是全国证券市场和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. 证券的发行市场又称
A. 一级市场
B. 二级市场
C. 三级市场
D. 柜台交易市场
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. 下列关于股票发行注册制的说法错误的是
A. 美国实行双重注册制
B. 注册制下,证券主管机构无权对证券本身做出价值判断
C. 注册制下,发行人的营业性质、财力和发展前景均不作为发行审核要件
D. 注册制下,发行人的发行权由审核部门以法定方式授予
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. MACD的组成部分包括
A. DIF和DEA
B. DIF和KDJ
C. DEA和KDJ
D. KDJ和MA

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. 甲企业 2012 年 6 月 30 日的流动资产净额为 1000 万元, 流动负债为 500 万元, 存货为 300 万元, 流动比率为

- A. 1 B. 1.5
C. 2 D. 3

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. 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. 证券上市程序的第二步是

- A. 申请 B. 退市
C. 上市 D. 审核

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, 请将其选出并将“答题卡”的相应代码涂黑。错涂、多涂、少涂或未涂均无分。

21. 股份公司按股东所负的责任不同, 可以分为

- A. 无限责任公司 B. 股份有限公司 C. 有限责任公司
D. 两合公司 E. 公开招股公司

22. 投资基金按其组织形式的不同, 可以分为

- A. 契约型投资基金 B. 封闭型投资基金 C. 平衡型投资基金
D. 公司型投资基金 E. 收入型投资基金

23. 证券交易所的功能包括

- A. 提供证券交易场所
B. 形成与公告价格
C. 研究、拟定证券和期货市场的方针政策
D. 披露公司信息, 引导资金流向
E. 制定交易规则, 对交易者进行严格监控

24. 移动平均线的特点包括

- A. 追踪趋势 B. 滞后性 C. 稳定性
D. 助涨助跌性 E. 支撑线和压力线的特性

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

第二部分 非选择题 (共 70 分)

三、名词解释题(本大题共 4 小题, 每小题 3 分, 共 12 分)

26. 股份有限公司

27. 开放型基金

28. 注册制

29. 证券经纪业务

四、简答题(本大题共 5 小题, 每小题 6 分, 共 30 分)

30. 简述契约型投资基金和公司型投资基金的主要区别。

31. 简述证券市场和一般商品市场的主要区别。

32. 简述股份资本必须遵循的资本原则。

33. 简述资本资产定价模型的基本假设。

34. 简述证券交易行为监管的主要内容。

五、论述题（本大题共 2 小题，每小题 14 分，共 28 分）

35. 试述企业债券的优点与缺点。

36. 试述道氏理论的原理和基本观点。