

2024 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. 证券市场最主要的功能是
A. 融通资金
B. 配置资源
C. 转移风险
D. 分散风险
2. 把证券分为政府证券、金融证券和公司证券,划分标准是
A. 交易内容
B. 是否上市
C. 是否有价
D. 发行主体
3. 专门为证券以及证券交易办理登记、存管、过户和资金结算交收业务的中介机构是
A. 信用评级机构
B. 证券登记结算公司
C. 证券咨询公司
D. 证券经营机构
4. 证券市场分为股票市场、债券市场和基金市场,划分标准是
A. 交易对象
B. 市场职能
C. 市场组织形式
D. 交易目的
5. 基于一定的信托契约原理而组织起来的代理投资行为,称为
A. 开放式基金
B. 封闭式基金
C. 契约型基金
D. 公司型基金

16. 以下关于系统风险的说法中，不正确的是
- A. 系统风险是那些由于某种全局性的因素引起的投资收益的可能变动
 - B. 系统风险是公司无法控制和规避的
 - C. 系统风险是不能通过多样化投资进行分散的
 - D. 系统风险对于不同证券收益的影响程度是相同的
17. 公用事业在行业划分中一般属于
- A. 完全竞争
 - B. 不完全竞争
 - C. 完全垄断
 - D. 寡头垄断
18. 技术分析适用于
- A. 短期的行情预测
 - B. 周期相对比较长的证券价格预测
 - C. 比较成熟的证券市场
 - D. 精确度要求不高的预测
19. 根据成交量的变化来预测股价未来走势的技术指标是
- A. ADR
 - B. PSY
 - C. OBV
 - D. KDJ
20. 杜邦分析涉及的指标是
- A. 流动比率
 - B. 速动比率
 - C. 市盈率
 - D. 总资产周转率

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. 对公司偿债能力进行分析，需要计算的指标有
- A. 流动比率
 - B. 速动比率
 - C. 资产负债率
 - D. 产权比率
 - E. 资产周转率
22. 下列关于各类债券的风险和收益的说法中，正确的有
- A. 金融债券是信用风险最小的债券
 - B. 付息债券的名义收益率是不变的，所以属于固定收益证券，实际上债券的价格变动频繁，所以债券是有风险的
 - C. 债券是对抗通货膨胀的好工具
 - D. 债券的价格因市场利率变化而变化，这称为债券的利率风险
 - E. 投资者在债券到期前若想收回债券投资，则需要在债券市场折现，从而可能带来一定损失，称为流动性风险

23. 下列关于投资组合理论的说法中, 正确的有
- A. 资产组合的收益率等于各个资产收益率的加权平均值, 权重为单个资产总值与资产组合总值的比例
 - B. 资产组合的收益率方差等于各个资产的收益率方差的加权平均值, 权重为单个资产总值与资产组合总值的比例
 - C. 当资产组合中不同资产的种类越多, 资产组合的收益率方差就越多地由资产之间的协方差决定
 - D. 投资多元化能降低风险, 是因为当资产种类增多时, 单个资产的收益率方差对组合的收益率方差的影响逐渐减小
 - E. 投资者承担高风险必然会得到高的回报率, 不然就没有人承担风险了
24. 受经济周期影响较为明显的行业有
- A. 耐用消费品
 - B. 钢铁
 - C. 生活必需品
 - D. 公用事业
 - E. 金融、地产
25. 影响股票价格波动的因素有
- A. 股票的供求状况
 - B. 投资者的心理因素
 - C. 各种突然事件
 - D. 投机
 - E. 公司经营状况

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. 存托凭证
- 27. 私募发行
- 28. 分级基金
- 29. 利率互换

四、简答题: 本大题共 4 小题, 每小题 6 分, 共 24 分。

- 30. 简述开放式基金与封闭式基金的区别。
- 31. 简述场外交易市场的功能。
- 32. 简述远期合约与期货合约的区别。
- 33. 简述证券投资风险的类型。

五、计算题：本大题共 1 小题，共 8 分。

34. 假设 A、B 两家上市公司的有关财务资料摘抄如下：

题 34 表

(单位：万元)

指标名称	A 公司	B 公司
资产总额	5,000	5,000
流动资产	4,000	4,500
净资产	1,300	1,000
负债总额	3,700	4,000
流动负债	2,600	3,300
净利润	500	450
发行在外的股票数	4,000 (万股)	4,500 (万股)

要求：(1) 根据上述资料计算下列指标：流动比率、资产净利率、每股收益。

(2) 比较计算结果，在两家公司之间选出比较合理的投资对象。

六、论述题：本大题共 2 小题，每小题 13 分，共 26 分。

35. 试述证券投资基本分析法。

36. 试述投资过程中的过度自信。