



2022 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。

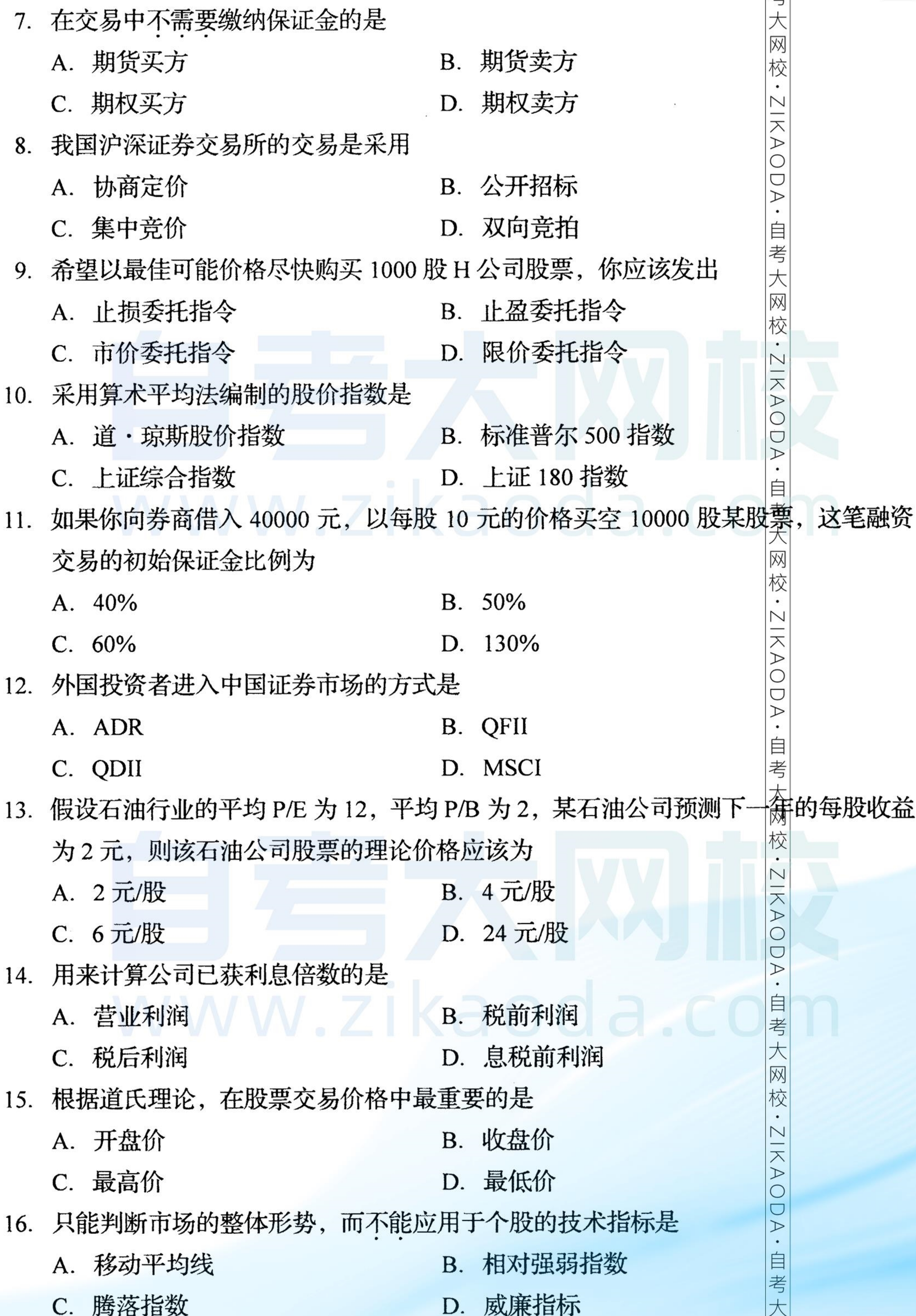
选择题部分

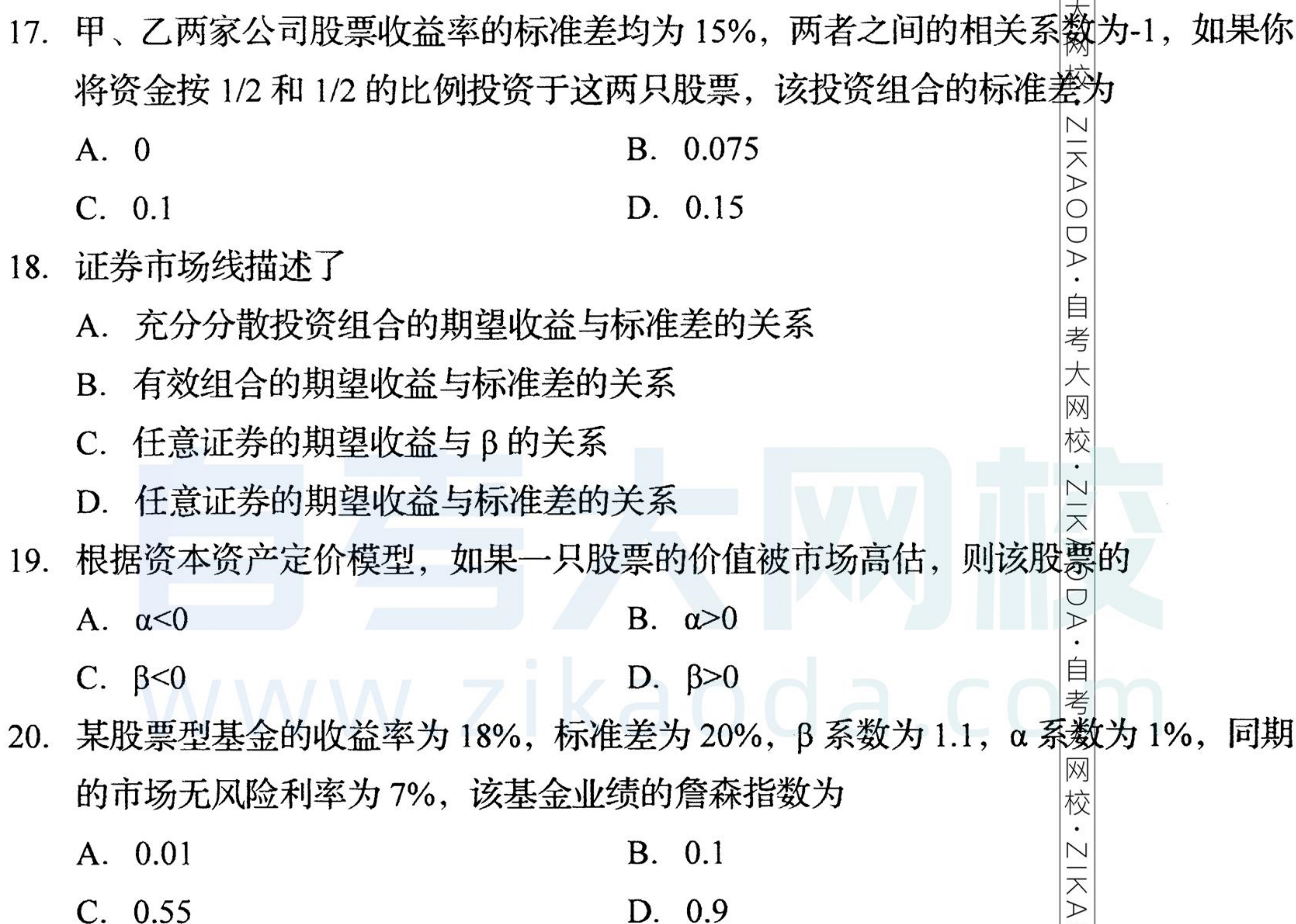
注意事项:

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. 股份有限公司的最高权力机构是
 - A. 工会
 - B. 董事会
 - C. 监事会
 - D. 股东大会
2. 下列金融工具中风险最低的是
 - A. 天弘货币市场基金
 - B. 华夏上证 50ETF
 - C. 华泰沪深 300ETF
 - D. 中国人寿存托凭证
3. 如果你预期利率将会下降,应该购买
 - A. 票面利率为 3%的 3 年期付息债券
 - B. 票面利率为 3%的 5 年期付息债券
 - C. 票面利率为 5%的 3 年期付息债券
 - D. 票面利率为 5%的 5 年期付息债券
4. 可转换债券实质上是嵌入了普通股票的
 - A. 看跌期权
 - B. 看涨期权
 - C. 认沽权证
 - D. 两平期权
5. 我国贴现国债的发行通常采用
 - A. 收益率招标
 - B. 缴款日招标
 - C. 认购规模招标
 - D. 价格招标
6. 多头套期保值是指
 - A. 在现货市场做多头,同时在期货市场做空头
 - B. 在现货市场做空头,同时在期货市场做多头
 - C. 在现货市场做多头,同时在期货市场做多头
 - D. 在现货市场做空头,同时在期货市场做空头





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
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. 下列属于金融衍生工具的有

A. 股票 B. 认股权证 C. 股指期货
D. 存托凭证 E. ETF 期权

22. 在我国，综合类证券公司的业务包括

A. 证券经纪 B. 证券承销 C. 证券自营
D. 存贷业务 E. 融资融券

23. 相对于普通股，优先股的优先主要体现在为

A. 优先认购股权 B. 优先分配盈余 C. 优先投票权
D. 优先获得利息 E. 优先分配剩余资产

24. 影响股票价格的宏观经济因素主要包括

A. 利率 B. 汇率 C. 股利
D. 物价 E. 经济增长



25. 下列关于证券投资收益率的说法正确的有
- A. 一般用算术平均收益率估计预期收益率
 - B. 一般用几何平均收益率估计预期收益率
 - C. 几何平均收益率真实反映了资产价值的变化
 - D. 一般来说, 算术平均收益率高于几何平均收益率
 - E. 证券价格波动越大, 算术平均收益率与几何平均收益率的差异越大

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. 私募证券
- 27. 清算价值
- 28. 速动比率
- 29. 弱式有效市场

四、简答题: 本大题共 4 小题, 每小题 6 分, 共 24 分。

- 30. 简述证券发行市场与流通市场的关系。
- 31. 简述证券投资基金的特征。
- 32. 简述证券投资风险的管理方法。
- 33. 简述证券市场集中管理模式的特点。

五、计算题: 本大题共 1 小题, 8 分。计算结果保留至小数点后二位。

- 34. 某投资者购买财政部发行的一年期国债, 该债券面值为 100 元, 按面值折扣 3% 的价格发行, 请计算投资者的实际收益率。

六、论述题: 本大题共 2 小题, 每小题 13 分, 共 26 分。

- 35. 试述行业分析的主要内容及意义。
- 36. 试述我国证券市场产生羊群效应的原因。