

最新证券投资分析模拟试题及答案

1. 中央银行在公开市场上买卖有价证券，将直接影响()，从而影响货币供应量。本资料来源公_众.号：文得课堂，更多证券类考试题库及视频，关注 gzh: 文得课堂。

- A. 商业银行法定准备金
- B. 商业银行超额准备金
- C. 中央银行再贴现
- D. 中央银行再贷款

【答案】B

2. 关于通货膨胀对经济的影响，下列说法错误的是()。[2018年9月真题]

- A. 通货膨胀会扭曲商品相对价格
- B. 通货膨胀会引起收入和财富的再分配
- C. 通货膨胀会降低资源配置效率
- D. 通货膨胀会导致高失业和国内生产总值的低增长

【答案】D

3. 过多依赖经验判断，对股价走势的影响难以数量化、程式化，受投资者主观能力的制约较大，这是()。[2019年3月真题]

- A. 技术分析法
- B. 量化分析法
- C. 指标分析法

D. 基本分析法

【答案】D

4. 以下关于宏观经济分析方法的说法，错误的是()。[2018年3月真题]

A. 总量分析侧重分析经济运行的动态过程

B. 对国民生产总值的分析属于结构分析法

C. 对物价水平的变动规律的分析属于总量分析法

D. 结构分析侧重分析经济现象的相对静止状态

【答案】B

5. 甲公司某年末的资产总额为 6000 万元，负债总额为 2000 万元，则其产权比率为()。[2018年3月真题]

A. 100%

B. 50%

C. 33.3%

D. 66.6%

【答案】B

6. 某人在未来三年中，每年将从企业获得一次性劳务报酬 50000 元，若企业支付报酬的时间既可在每年年初，也可以在每年年末，若年利率为 10%，由于企业支付报酬时点的不同，则三年收入的现值差为()。[2016年6月、4月真题]

A. 12434.26元

B. 4545.45元

C. 14683.49元

D. 8677.69元

【答案】A

7. 在计算利息额时，按一定期限，将所生利息加入本金再计算利息的计息方法是()。[2016年5月真题]

A. 单利计息

B. 存款计息

C. 复利计息

D. 贷款计息

【答案】C

8. 某机构投资者计划进行为期2年的投资，预计第2年年末收回的现金流为121万元。如果按复利每年计息一次，年利率10%，则第2年年末收回的现金流现值为()万元。[2016年5月真题]

A. 100

B. 105

C. 200

D. 210

【答案】A

9. 某人按10%的年利率将1000元存入银行账户，若每年计算2次复利(即每年付息2次)，则两年后其账户的余额为()。[2016年4月真题]

A. 1464.10元

- B. 1200元
- C. 1215.5元
- D. 1214.3元

【答案】C 本资料来源公_众.号：文得课堂，更多证券类考试题库及视频，关注 gzh：文得课堂。

10. 如果当前的证券价格反映了历史价格信息和所有公开的价格信息，则该市场属于()。[2016年4月真题]

- A. 弱式有效市场
- B. 半弱式有效市场
- C. 强式有效市场
- D. 半强式有效市场

【答案】D

11. 假设某持仓组合的 β_S 是1.2，如果投资经理预测大盘会下跌，他准备将组合的 β_P 降至0，假设现货市值1000万元，沪深300期货指数为5000， β_N 为1，则他可以在期货市场()，实现alpha套利。[2016年4月真题]

- A. 买入8份合约
- B. 买入12份合约
- C. 卖空12份合约
- D. 卖空8份合约

【答案】D

12. 金融期货是指交易双方在集中的交易场所通过()的方式

进行的标准化金融期货合约的交易。

- A. 公开竞价
- B. 买方向卖方支付一定费用
- C. 集合竞价
- D. 协商价格

【答案】 A

13. 金融衍生工具是价格取决于()价格变动的派生金融产品。

- A. 基础金融产品
- B. 股票市场
- C. 外汇市场
- D. 债券市场

【答案】 A

14. 关于金融衍生工具的特征，下列说法错误的是()。

- A. 不要求初始净投资，或与对市场情况变化有类似反应的其他类型合同相比，要求很少的初始净投资
- B. 一般在当期结算
- C. 其价值随特定利率、金融工具价格、商品价格、汇率、价格指数、费率指数、信用等级、信用指数或其他类似变量的变动而变动，变量为非金融变量的，该变量与合同的任一方不存在特定关系
- D. 在未来某一日期结算

【答案】 B

15. 股权类产品的衍生工具不包括()。

- A. 股票指数期货
- B. 股票期货
- C. 货币期货
- D. 股票期权

【答案】C

16. 若期货交易保证金为合约金额的 5%，则期货交易者可以控制的合约资产为所投资金额的()倍。

- A. 5
- B. 10
- C. 20
- D. 50

【答案】C

17. 金融衍生工具的价值与基础产品或基础变量紧密相联，具有规则的变动关系，这体现了金融衍生工具的()。

- A. 跨期性
- B. 期限性
- C. 联动性
- D. 不确定性或高风险性

【答案】C

18. 任何金融工具都可能出现价格的不利变动而带来资产损失的可能性，这是()。

- A. 信用风险
- B. 市场风险
- C. 法律风险
- D. 结算风险

【答案】B

19. 下列关于金融衍生工具的叙述，错误的是()。

- A. 无论是哪一种金融衍生工具，都会影响交易者在未来一段时间内或未来某时点上的现金流
- B. 基础工具价格的轻微变动也许就会带来交易者的大盈大亏
- C. 基础工具价格的变幻莫测决定了金融衍生工具交易盈亏的不稳定性，这是金融衍生工具高风险性的重要诱因
- D. 衍生工具的结算风险是指因交易或管理人员的人为错误或系统故障、控制失灵而造成损失的可能性

【答案】D

20. 下列各项属于交易所交易的衍生工具的是()。

- A. 公司债券条款中包含的赎回条款
- B. 公司债券条款中包含的返售条款
- C. 公司债券条款中包含的转股条款
- D. 在期货交易所交易的期货合约

【答案】D

21. 某投资者 5 年后有一笔投资收入为 30 万元，投资的年利率为 10%，用复利方法计算的该项投资现值介于()之间。

- A. 17.00万元至 17.50万元
- B. 17.50万元至 18.00万元
- C. 18.00万元至 18.50万元
- D. 18.50万元至 19.00万元

【答案】D

22. 有价证券的价格是以一定的市场利率和预期收益为基础计算得出的()。

- A. 期值
- B. 现值
- C. 有效利率
- D. 复合利率

【答案】B

23. 某债券为一年付息一次的息票债券，票面价值为 1000 元，息票利率为 8%，期限为 10 年，当市场利率为 7% 时，该债券的发行价格应为()元。

- A. 1000
- B. 1070
- C. 1076
- D. 1080

【答案】B

24. 在资产定价模型中， β 值为 1 的证券被称为具有()。

- A. 激进型风险

- B. 防卫型风险
- C. 平均风险
- D. 系统性风险

【答案】C

25. 下列关于市场有效性与获益情况说法错误的是()。

- A. 在弱式有效市场中，投资者不能根据历史价格信息获得超额收益
- B. 在半强式有效市场中，投资者可以根据公开市场信息获得超额收益
- C. 在半强式有效市场中，投资者可以获得超额收益
- D. 在强式有效市场中，不能获得超额收益

【答案】B

26. 当()时，投资者将选择高 β 值的证券组合。

- A. 市场组合的实际预期收益率小于无风险利率
- B. 市场组合的实际预期收益率等于无风险利率
- C. 预期市场行情上升
- D. 预期市场行情下跌

【答案】C

本资料来源公_众.号：文得课堂，更多证券类考试题库及视频，关注gzh：文得课堂。

27. 市场组合()。

- A. 由证券市场上所有流通与非流通证券构成

- B. 只有在与无风险资产组合后才会变成有效组合
- C. 与无风险资产的组合构成资本市场线
- D. 包含无风险证券

【答案】C

28. 根据组合投资理论，在市场均衡状态下，单个证券或组合的收益 $E(r)$ 和风险系数 β 之间呈线性关系，反映这种线性关系的在 $E(r)$ 为纵坐标、 β 为横坐标的平面坐标系中的直线被称为()。

- A. 压力线
- B. 证券市场线
- C. 支持线
- D. 资本市场线

【答案】B

29. 反映任何一种证券组合期望收益水平与系统风险水平之间均衡关系的方程式是()。

- A. 证券市场线方程
- B. 证券特征线方程
- C. 资本市场线方程
- D. 马柯威茨方程

【答案】A

30. 下列关于 β 系数说法正确的是()。

- A. β 系数的值越大，其承担的系统风险越小
- B. β 系数是衡量证券系统风险水平的指数

以上内容仅为本文档的试下载部分，为可阅读页数的一半内容。如要下载或阅读全文，请访问：<https://d.book118.com/757002111141010042>