

2006年证券投资分析最新模拟试题（部分）PDF转换可能丢失图片或格式，建议阅读原文

https://www.100test.com/kao_ti2020/40/2021_2022_2006_E5_B9_B4_E8_AF_81_c33_40884.htm

一、单项选择题。以下各小题所给出的4个选项中，只有一项最符合题目要求，请将正确选项的代码填入空格内。（共70小题，每小题0.5分）

1、如果一种债券的到期收益率在整个期限内没有变化，则其价格折扣或升水会随着债券剩余期限的缩短而减少，并且这种减少的速度（ ）。 A．越来越慢 B．越来越快 C．不变 D．不确定

2、假设有如下国债券数据：国债到期期限 息票率 A 10年 8% B 10年 4% 上述两种债券的面值相同，均在每年年末支付利息。从理论上讲，当利率发生变化时，债券B的价格变化幅度与债券A的价格变化幅度相比，（ ）。 A．前者小于后者 B．前者大于后者 C．前者等于后者 D．前者是否大于后者取决于债券B的面值是否小于债券A的面值

3、股票的市场价格与认股权证的认购股票的价格之间的差额被称为认股权证的（ ）。 A．溢价 B．理论价值 C．升水 D．贴水

4、设t为现在时刻，T为指数期货合约的到期日， F_t 为指数期货的当前价格， S_t 为基础指数的现值，r为无风险利率，d为连续的红利支付率。那么 F_t 与 S_t 之间的关系为（ ）。 A． $F_t = S_t[1 - (d-r)(T-t)/360]$ B． $F_t = S_t (r-d)(T-t)/360$ C． $F_t = S_t[1 + (r-d)(T-t)/360]$ D． $F_t = S_t (r-d)(T-t)/360$

5、设t为现在时刻，T为指数期货合约的到期日， F_t 为指数期货的当前价格， S_t 为基础指数的现值，r为无风险利率，d为连续的红利支付率。那么，指数期货理论价格公式中代表现货持有成本和时间价值的那一项是（ ）。 A． $S_t(r-d)(T-t)/360$ B． $(r-d)(T-t)/360$ C． $(r-d)(T-t)$ D

. $St(r-d)(T-t)$ 6、金融期权有内在价值，也有外在价值，后者是指，（ ）。 A . 期权内在价值超过该期权协定价格的部分 B . 期权市场价格超过该期权内在价值的部分 C . 期权内在价值超过该期权时间价值的部分 D . 期权市场价格低于该期权标的资产市场价格的部分 7、一般而言，期权合约的时间价值、协定价格、标的资产市场价格三者之间的关系是（ ）。 A . 协定价格与时间价值差距越大，标的资产市场价格就越低 B . 时间价值与标的资产市场价格差距越大，协定价格就越高 C . 协定价格与标的资产市场价格的差额，就等于时间价值 D . 协定价格与标的资产市场价格差距越大，时间价值就越 8、在期权协定价格一定时，期权有效期内标的资产产生分红付息收益将使（ ）。 A . 看涨期权价格下降 B . 看涨期权价格上升 C . 实值期权价格下降 D . 实值期权价格上升 9、对股票市盈率的估计，以下几种方法中不属于简单估计法的是（ ）。 A . 算术平均数法或中间数法 B . 趋势调整法 C . 回归调整法 D . 回归分析法 10、从分类的角度看，行业分析方法中的问卷调查法应属于（ ）。 A . 历史资料研究法 B . 调查研究法 C . 归纳与演绎法 D . 比较分析法 11、行业分析的比较研究法一般不包括（ ）。 A . 行业增长横向比较分析 B . 行业增长纵向比较分析 C . 相关分析 D . 行业未来增长率预测分析 100Test 下载频道开通，各类考试题目直接下载。详细请访问 www.100test.com