

2010年证券业从业资格考试指导教材辅导书
根据2010年证券业从业资格考试大纲和统编教材编写

2010年

证券业从业资格考试 模拟试题应试精解

全新版
2010.7-2011.6

证券交易

国家证券业从业资格考试研究组 © 编审



中国法制出版社

2010年证券业从业资格考试指导教材辅导书
根据2010年证券业从业资格考试大纲和统编教材编写

2010年

证券业从业资格考试 模拟试题应试精解

全新版
2010.7-2011.6

证券交易

图书在版编目(CIP)数据

证券交易/国家证券业从业资格考试研究组编审.
—北京:中国民主法制出版社,2010.9
(2010年证券业从业资格考试模拟试题应试精解)
ISBN 978-7-80219-749-7

I. ①证… II. ①国… III. ①证券交易—资格考核—
解题 IV. ①F830.91-44

中国版本图书馆CIP数据核字(2010)第188896号

图书出品人:肖启明
文案统筹:刘海涛
责任编辑:逯卫光 翟琰萍

书名/证券交易

Zhengquan Jiaoyi

作者/国家证券业从业资格考试研究组 编审

出版·发行/中国民主法制出版社

地址/北京市丰台区右安门外玉林里7号(100069)

电话/63055903(编辑部) 63057714(发行部)

传真/63056975 63056983

E-mail:/MZFZ@263.net

经销/新华书店

开本/16开 710毫米×1000毫米

印张/13 字数/213千字

版本/2010年10月第1版 2010年10月第1次印刷

印刷/河北永清金鑫印刷有限公司

书号/ISBN 978-7-80219-749-7

定价/25.00元

出版声明/版权所有,侵权必究。

(如有缺页或倒装,本社负责退换)

前言

PREFACE

考试成绩 = 知识的掌握程度 + 应试能力

进行习题演练是巩固知识、迅速提高应试能力的有效手段。可以这样讲,选择一本优秀的模拟试题,认真地去演练分析,在复习应试中将起到事半功倍的效果。

本套丛书正是基于广大读者的这种迫切需要,由从事证券研究与培训的专家学者,依据 2010 年考试大纲和统编教材,结合我们多年来对命题规律的精准把握,精心编写而成。

本套丛书与同类辅导资料相比,具有以下鲜明的特色:

专业原创 本书的作者团队全部为证券专业人士,既有扎实的理论基础,又有丰富的应试培训经验。所编习题,均是在认真研读参照 2010 年统编教材,认真分析往年试题的基础上独立编撰而成,具有明确的应试提升功能。

高度保真 我们编制的模拟试卷,体现了形式和实质的双重保真。形式保真是指题型、题量、各章内容分布、考试时间与真实考试基本一致。实质保真就是试题的特点、试题的难度、考点的分布与真实考试基本一致。

我们在模拟试卷中引用了近 3 年来大量的考试真题,同时对因时间发展而过时的内容进行了删除和改编,既发挥了历年考试的引导作用,又避免了陈旧内容和生偏内容的误导。

精讲精练 一本好的教辅书不应该只是裁判,更应该是教练。只给答案,不讲原因是很多辅导书的一大缺陷。做完题后,仅对对答案,不分析原因,不力求改正,做题的效果将大打折扣。

在本套丛书的编写过程中,编写者除给出标准参考答案外,还给出了深入浅出、简明扼要的精讲解答,这对于发挥模拟试卷的功能,提高读者的应试能力,将发挥关键的作用。

尽管我们对这套丛书精心编写、认真审核,但由于时间有限,遗漏与不足在所难免,恳请广大读者朋友不吝指正,我们的电子邮箱是 tianxiacaifu@126.com,服务热线:13681387472。

证券业从业资格考试研究组
2010年10月于北京

目 录

《证券交易》模拟试题(一)	1
《证券交易》模拟试题(一)参考答案与试题精解	18
《证券交易》模拟试题(二)	41
《证券交易》模拟试题(二)参考答案与试题精解	57
《证券交易》模拟试题(三)	80
《证券交易》模拟试题(三)参考答案与试题精解	97
《证券交易》模拟试题(四)	120
《证券交易》模拟试题(四)参考答案与试题精解	137
《证券交易》模拟试题(五)	160
《证券交易》模拟试题(五)参考答案与试题精解	177

《证券交易》模拟试题(一)

一、单项选择题(本大题共 60 小题,每小题 0.5 分,共 30 分)以下各小题所给出的四个选项中,只有一项最符合题目要求,请选出正确的选项,不选、错选均不得分。

1. 在竞价市场中,证券交易价格是由市场上的买方订单和卖方订单共同驱动的,这属于()的特点。

- A. 指令驱动系统
- B. 报价驱动系统
- C. 经纪人驱动系统
- D. 时间驱动系统

2. 证券交易的()原则要求证券交易参与各方应依法及时、真实、准确、完整地向社会发布自己的有关信息。

- A. 公平
- B. 公开
- C. 公正
- D. 安全

3. 我国证券交易所目前采用的报价方式是()。

- A. 口头报价
- B. 书面报价
- C. 电脑报价
- D. 人工报价

4. 证券交易所决定接纳或者开除会员应当在决定后的()个工作日内向中国证监会备案。

- A. 5
- B. 7
- C. 10
- D. 30

5. 证券公司经营证券承销与保荐、证券自营、证券资产管理业务之一的,其注册资本不得低于人民币()元。

- A. 5000 万
- B. 1 亿
- C. 2 亿
- D. 5 亿

6. ()的核心要求是实现市场信息的公开化。

- A. 透明原则
- B. 公开原则
- C. 公正原则
- D. 公平原则

7. ()是由交易双方订立的、约定在未来某日期按成交时约定的价格交割一定数量的某种商品的标准化协议。

- A. 回购交易合约
- B. 远期交易合约
- C. 现货交易合约
- D. 期货合约

8. 经国务院证券监督管理机构批准,证券公司可以经营的业务不包

括()。

- A. 与证券交易、证券投资活动有关的财务顾问
- B. 证券承销与保荐
- C. 证券资产管理
- D. 期货买卖

9. ()是证券交易的中介,是独立于买卖双方的第三者,与客户之间不存在从属或依附的关系。

- A. 中介公司
- B. 中国监管协会
- C. 中介银行
- D. 证券经纪商

10. 目前,我国具有法人资格的证券经纪商是指在证券交易中代理买卖证券、从事经纪业务的()。

- A. 证券公司
- B. 资产管理公司
- C. 信托公司
- D. 基金公司

11. 下列关于连续竞价的说法错误的是()。

- A. 能成交者予以成交,不能成交者等待机会成交
- B. 在无撤单的情况下,委托当日有效
- C. 开盘集合竞价期间未成交的买卖申报,自动进入连续竞价
- D. 连续竞价期间未成交的买卖申报,自动撤销

12. 涨跌幅价格的计算公式为()。

- A. 涨跌幅价格 = 前收盘价 $\times (1 \pm \text{涨跌幅比例})$
- B. 涨跌幅价格 = 今开盘价 $\times (1 \pm \text{涨跌幅比例})$
- C. 涨跌幅价格 = 前平均价 $\times (1 \pm \text{涨跌幅比例})$
- D. 涨跌幅价格 = 前最高价 $\times (1 \pm \text{涨跌幅比例})$

13. 在报价驱动系统中,做市商的收入来源是()。

- A. 佣金
- B. 手续费
- C. 买卖差价
- D. 投资收入

14. 某股票即时揭示的卖出申报价格和数量分别为 15.60 元和 1000 股、15.50 元和 800 股、15.35 元和 100 股,即时揭示的买入申报价格和数量分别为 15.25 元和 500 股、15.20 元和 1000 股、15.15 元和 800 股。若此时该股票有一笔买入申报进入交易系统,价格为 15.50 元,数量为 600 股,则相应的成交结果为()。

- A. 以 15.35 元成交 600 股
- B. 以 15.35 元成交 100 股、15.50 元成交 500 股
- C. 以 15.50 元成交 600 股

- D. 以 15.35 元成交 100 股、其余 500 股的申报失效
15. 网上竞价发行方式的最大缺陷是()。
- A. 效率低
B. 手续繁琐
C. 股价易被操纵
D. 发行价格与二级市场上的交易价格有很大差别
16. A 公司权证的某日收盘价是 6 元, A 公司股票收盘价是 24 元, 行权比例为 1。次日 A 公司股票最多可以上涨或下跌 10%, 则权证次日的涨跌幅比例为()。
- A. 50% B. 40% C. 20% D. 10%
17. 深圳证券交易所配股认购于()开始, 认购期为()个工作日。
- A. R+1 日, 5 B. R 日, 10 C. R+1 日, 10 D. R-1 日, 15
18. 上海、深圳证券交易所上市证券的分红派息, 主要是通过()进行的。
- A. 各银行
B. 各证券公司
C. 交易所
D. 登记结算公司的交易清算系统
19. 上市开放式基金的上市首日的开盘参考价为上市首日前一交易日的()。
- A. 基金份额平均值 B. 基金份额净值
C. 基金份额市值 D. 基金份额总值
20. 上海证券交易所开放式基金申购、赎回的成交价格按()确定。
- A. 1 元 B. 前日基金份额净值
C. 当日市场价格 D. 当日基金份额净值
21. 证券自营业务原始凭证以及有关业务文件、资料、账册、报表和其他必要的材料应至少妥善保存()。
- A. 5 年 B. 10 年 C. 15 年 D. 20 年
22. 具有相关条件的证券公司向()提出申请, 并提供必要文件, 经其相关部门批准后, 方可成为证券交易所的会员。
- A. 证券交易所 B. 国务院
C. 中国人民银行 D. 中国证监会
23. 无涨跌幅限制证券的大宗交易成交价格, 由买卖双方 in 收盘价的上下

- ()或当日已成交的最高、最低价之间自行协商确定。
- A. 10% B. 20% C. 30% D. 50%
24. 债券大宗交易以及专项资产管理计划协议交易实行()。
- A. 当日回转交易 B. T+1 日回转交易
C. T+2 日回转交易 D. T+3 日回转交易
25. 询价交易中,交易商以()方式申报。
- A. 匿名 B. 匿名或实名
C. 实名 D. 匿名和实名
26. 所有合格投资者持有同一上市公司挂牌交易 A 股数额,合计达到该公司总股本的()及其后每增加()时,证券交易所于该交易日结束后通过交易所网站,公布合格投资者已持有该公司挂牌交易 A 股的总数及其占公司总股本的比例。
- A. 10% ,1% B. 10% ,2% C. 15% ,3% D. 16% ,2%
27. 下列各项不属于定向资产管理业务的特点是()。
- A. 证券公司与客户必须是“一对一”
B. 具体投资方向应在资产管理合同中约定
C. 必须在单一客户的专用证券账户中经营运作
D. 通过专门账户为客户提供资产管理服务
28. 证券公司从事资产管理业务,其净资本不低于人民币()亿元。
- A. 1 B. 2 C. 5 D. 10
29. 以下不属于证券自营买卖对象的是()。
- A. 国债 B. 权证 C. B 股 D. 证券投资基金
30. 证券交易所会员应当向证券交易所履行的定期报告义务之一是:每月前()个工作日内报送上月统计报表及风险控制指标监管报表。
- A. 5 B. 6 C. 7 D. 8
31. 建立健全自营业务风险监控系统的功能,应在监控系统中设置相应的(),通过系统的预警触发装置自动显示自营业务风险的动态变化。
- A. 敏感性指标 B. 风险监控泛值
C. 风险测量泛值 D. 风险预警指标
32. 柜台自营买卖是指证券公司在()以自己的名义与客户之间进行的证券自营买卖。
- A. 银行柜台 B. 其营业柜台
C. 证券交易所 D. 证券交易系统

33. 从事证券自营业务的证券公司其注册资本最低限额应达到人民币()。

- A. 3000 万元 B. 5000 万元
C. 1 亿元 D. 2 亿元

34. 证券公司申请融资融券业务试点,应当经营证券经纪业务已满()年。

- A. 2 B. 3 C. 4 D. 5

35. 融资融券业务的决策与授权体系原则上按照()架构设立和运行。

- A. 董事会——分支机构
B. 董事会——业务决策机构
C. 董事会——业务决策机构——分支机构
D. 董事会——业务决策机构——业务执行部门——分支机构

36. 限定性集合资产管理计划投资于业绩优良、成长性高、流动性强的股票等权益类证券以及股票型证券投资基金的资产,不得超过该计划资产净值的(),并应当遵循分散投资风险的原则。

- A. 10% B. 15% C. 20% D. 25%

37. 证券公司应当自专用证券账户开立之日起()个交易日内,将专用证券账户报证券交易所备案。

- A. 2 B. 3 C. 5 D. 15

38. 证券公司应当在集合资产管理计划开始投资运作之日起()个月内,使集合资产管理计划的投资组合比例符合集合资产管理合同的约定。

- A. 12 B. 6 C. 3 D. 1

39. 以下关于证券公司开展资产管理业务的禁止行为,不正确的是()。

- A. 将证券资产管理业务与证券公司其他业务混合操作
B. 以获取佣金或者其他利益为目的,用客户委托资产进行不必要的交易
C. 接受单一客户委托资产净值低于规定的最低限额
D. 定向资产管理业务先于自营业务进行交易

40. 证券公司参与多个集合计划的自有资金总额,不得超过证券公司净资产的()。

- A. 10% B. 15% C. 20% D. 25%

41. 买断式回购与质押式回购的区别在于()。

- A. 在初始交易中,债券所有权随交易的发生而转移
B. 在最终交易中,债券所有权随交易的发生而转移

- C. 在最终交易中,回购金额的计算方法不同
D. 在最终交易中,回购的债券的种类不同
42. 对于交易席位的使用,下列选项正确的是()。
- A. 与他人共用一个席位 B. 会员转让交易席位
C. 将席位出租 D. 退回交易所席位
43. 证监会派出机构应当自收到融资融券申请书之日起()个工作日内,向证监会出具是否同意申请人开展融资融券业务试点的书面意见。
- A. 3 B. 5 C. 10 D. 15
44. 证券公司应当在每一月份结束后()个工作日内,向证监会、注册地证监会派出机构和证券交易所书面报告当月的融资融券相关情况。
- A. 10 B. 15 C. 20 D. 30
45. 以下关于证券公司的账户体系的说法,不正确的有()。
- A. 融券专用证券账户,用于记录证券公司持有的拟向客户融出的证券和客户归还的证券,不得用于证券买卖
B. 客户信用交易担保证券账户,用于记录客户委托证券公司持有、担保证券公司因向客户融资融券所生债权的证券
C. 信用交易资金交收账户,用于客户融资融券交易的证券结算
D. 融资专用资金账户,用于存放证券公司拟向客户融出的资金及客户归还的资金
46. 客户信用证券账户为证券公司客户信用交易担保证券账户的()证券账户。
- A. 初始 B. 一级 C. 二级 D. 三级
47. 客户只能与()家证券公司签订融资融券合同,向()家证券公司融入资金和证券。
- A. 1,2 B. 2,2 C. 2,1 D. 1,1
48. 在我国,()事实上是作为证券市场中央结算系统各参与方的共同对手方,与结算参与人之间进行资金的多边净额结算。
- A. 中国证券登记结算有限责任公司
B. 中国金融期货交易所
C. 中国证券交易结算公司
D. 上海证券交易所
49. 某客户持有上海证券交易所上市96国债(6)现券1万手。该国债当日收盘价为121.85元,当月的标准券折算率为1:1.27。该客户最多可回购融入

的资金是() (不考虑交易费用)。

- A. 1218.50 万元 B. 1000.00 万元
C. 1270.00 万元 D. 1200.00 万元

50. 沪、深证券交易所以国债为主要品种的质押式回购交易的开办时间分别是()。

- A. 1993 年 12 月和 1994 年 11 月 B. 1993 年 10 月和 1994 年 12 月
C. 1993 年 12 月和 1994 年 10 月 D. 1994 年 10 月和 1993 年 12 月

51. 国债买断式回购交易按照()原则进行。

- A. 一次成交、一次清算 B. 一次成交、两次清算
C. 两次成交、一次清算 D. 两次成交、两次清算

52. 标准券是一种虚拟的回购综合债券,是由各种债券根据一定()折合相加而成。

- A. 面值 B. 折算率 C. 收益率 D. 折现率

53. 《上海证券交易所债券交易实施细则》规定,债券回购交易集中竞价时单笔申报最大数量应当不超过()。

- A. 1 万手 B. 5 万手 C. 1 万张 D. 5 万张

54. 证券交易所质押式回购的报价方式是以债券回购交易资金的()进行报价。

- A. 平均收益率 B. 年收益率
C. 内部报酬率 D. 再投资收益率

55. 下列关于净额清算的说法,不正确的有()。

- A. 清算证券时,同一清算期内不同种证券也能合并计算
B. 清算证券时,同一清算期内同种证券可以合并计算
C. 可以简化操作手续,提高清算效率
D. 清算价款时,同一清算期内发生的不同种类证券的买卖价款可以合并计算

56. 国债买断式回购到期购回结算的交收时点为()。

- A. R 日(R 为到期日)14:00 B. R 日(R 为到期日)17:00
C. R + 1 日(R 为到期日)14:00 D. R + 1 日(R 为到期日)17:00

57. 证券交易所决定接纳或开除会员应在()个工作日内向中国证监会备案。

- A. 5 B. 10 C. 15 D. 30

58. 根据不同的情况和条件债券交易机制有着各种各样的目标,但是从基

本上看,以下不属于债券机制的基本目标的是()。

- A. 稳定性 B. 收益性 C. 有效性 D. 流动性

59. 股票交易如果在证券交易所进行,可称谓()。

- A. 上市交易 B. 场外交易
C. 柜台交易 D. 店头交易

60. 在证券交易中,信用交易的主要特征在于()。

- A. 证券卖出者向证券买入者提供了信用
B. 证券买入者向证券卖出者提供了信用
C. 经纪人向投资者提供了信用
D. 银行向证券买入者提供了信用

二、多项选择题(共40题,每题1分,共40分)以下各小题所给出的四个选项中,有两项或两项以上符合题目的要求,请选出正确的选项,漏选、错选均不得分。

61. 下列属于政府债券的有()。

- A. 金融债券 B. 国债 C. 地方债 D. 可转换债券

62. 我国证券交易所规定的会员必须承担的义务包括()。

- A. 对证券交易所事务和其他会员的活动进行监督
B. 维护投资者和证券交易所的合法权益
C. 按规定缴纳各项经费和提供有关信息资料
D. 派遣合格代表入场从事证券交易活动

63. 根据交易合约的签订与实际交割之间的关系,证券交易的方式有()。

- A. 现货交易 B. 回购交易
C. 远期交易 D. 期货交易

64. 以下关于封闭式基金的说法,正确的有()。

- A. 封闭式基金在成立后,基金管理公司可以申请其基金在证券交易所上市
B. 封闭式基金如果获得批准,则投资者就可以在二级市场上买卖基金份额
C. 封闭式基金份额的申购价格和赎回价格,是在基金资产净值的基础上再加一定的手续费而确定的

D. 封闭式基金如果是非上市的,投资者可以进行基金份额的申购和赎回

65. 经纪业务主要环节包括()

- A. 证券账户的开立 B. 证券账户管理
C. 资金账户管理 D. 证券委托买卖

66. 对委托人撤销的委托,证券营业部须及时将冻结的()解冻。
A. 资金 B. 证券 C. 账户 D. 股东卡
67. 下列关于过户费的收取正确的是()。
A. 上海证券交易所 A 股过户费为成交面额的 1‰,起点为 1 元
B. 深圳证券交易所免收 A 股过户费
C. 上海证券交易所 B 股结算费为成交金额的 0.5‰,但最高不超过 500 美元
D. 目前免收基金交易过户费
68. 证券经纪业务的特点有()
A. 业务对象的广泛性 B. 证券经纪商的中介性
C. 客户指令的权威性 D. 客户资料的保密性
69. 在申报价格最小变动单位方面,以下符合《深圳证券交易所交易规则》规定的有()。
A. A 股、债券的申报价格最小变动单位为 0.01 元人民币
B. 基金交易为 0.001 元人民币
C. B 股交易为 0.01 港元
D. 债券质押式回购交易为 0.005 元人民币
70. 可转换债券的初始转股价格因公司()进行调整。
A. 配股 B. 送红股
C. 增发新股 D. 降低转股价格
71. 权证交易中,禁止的事项包括()。
A. 禁止任何人直接操纵权证价格
B. 权证发行人不得买卖自己发行的权证
C. 标的证券发行人不得买卖标的证券对应的权证
D. 禁止内幕信息知情人员利用内幕信息进行权证交易活动,获取不正当利益
72. 新股网上定价发行与网上竞价发行的不同之处在于()。
A. 承销方式不同
B. 认购成功者的确认方式不同
C. 发行价格的确定方式不同
D. 认购方式不同
73. 股票网上发行具有()优点。
A. 稳定性 B. 安全性 C. 经济性 D. 高效性

74. 在上海证券交易所进行的证券买卖符合以下条件的,可以采用大宗交易方式()。

A. A 股单笔买卖申报数量应当不低于 50 万股,或者交易金额不低于 300 万元人民币

B. B 股单笔买卖申报数量应当不低于 50 万股,或者交易金额不低于 30 万元人民币

C. 基金大宗交易的单笔买卖申报数量应当不低于 300 万份

D. 国债及债券回购大宗交易的单笔买卖申报数量应当不低于 5 万手

75. 根据《深圳证券交易所综合协议交易平台业务实施细则》的规定,下列交易可以通过协议平台进行()。

A. 权益类证券大宗交易,包括 A 股、B 股、基金等

B. 债券类大宗交易

C. 专项资产管理计划收益权份额协议交易

D. 交易所规定的其他交易

76. 上市公司出现以下情形之一的,证券交易所对其股票交易实行退市风险警示()。

A. 最近 3 年连续亏损

B. 在法定期限内未披露年度报告或者半年度报告,公司股票已停牌 2 个月

C. 处于股票恢复上市交易日至其恢复上市后首个年度报告披露日期间

D. 因财务会计报告存在重大会计差错或虚假记载,被中国证监会责令改正,在规定期限内未改正,且公司股票已停牌 2 个月

77. 证券交易所在每个交易日都要发布的交易信息包括()。

A. 历史信息

B. 即时行情

C. 证券指数

D. 证券交易公开信息

78. 自营业务中涉及()等方面的重大决策应当经过集体决策并采取书面形式,由相关人员签字确认后存档。

A. 资产配置

B. 业务授权

C. 自营规模

D. 风险限额

79. 在证券公司自营业务内控机制中,建立完备的业绩考核和激励制度,应遵循()原则,对自营业务人员的投资能力、业绩水平等情况进行评价。

A. 客观

B. 公开

C. 公正

D. 可量化

80. 证券公司应当按照监管部门和证券交易所的要求报送自营业务信息,报告的内容包括()。

- A. 自营风险监控报告
 - B. 公司的人员结构
 - C. 自营业务账户、席位情况
 - D. 涉及自营业务规模、风险限额、资产配置、业务授权等方面的重大决策
81. 下列属于操纵证券市场手段的有()。
- A. 假借他人名义或者以个人名义进行自营业务
 - B. 集中资金优势、持股优势或者利用信息优势联合或者连续买卖
 - C. 非法获取内幕信息并利用内幕信息买卖证券
 - D. 与他人串通,以事先约定的时间、价格和方式相互进行证券交易
82. 资产管理业务的主要类型有()。
- A. 为单一客户办理定向资产管理业务
 - B. 为多个客户办理集合资产管理业务
 - C. 为多个客户办理定向资产管理业务
 - D. 为客户特定目的办理专项资产管理业务
83. 证券公司从事资产管理业务,应当符合的条件有()。
- A. 经中国证监会核定具有证券资产管理业务的经营范围
 - B. 净资本不低于人民币5亿元,且符合中国证监会关于经营证券资产管理业务的各项风险监控指标的规定
 - C. 资产管理业务人员具有证券业从业资格,无不良行为记录
 - D. 最近3年未受到过行政处罚或者刑事处罚
84. 定向资产管理业务的内部控制措施包括()。
- A. 专门、独立的业务运作
 - B. 建立授权管理与问责制
 - C. 合理的规模控制
 - D. 独立、客观的投资研究
85. 资产托管机构办理集合资产管理计划资产托管业务应当履行的职责有()。
- A. 安全保管集合资产管理计划资产
 - B. 监督证券公司集合资产管理计划的经营运作
 - C. 出具资产托管报告
 - D. 执行证券公司的投资或者清算指令,并负责办理集合资产管理计划资产运营中的资金往来
86. 证券公司定向资产管理业务应当建立投资交易控制体系,主要内容包括()。
- A. 建立投资指令审核制度