

## 金融期货基础知识测试试题（A卷）

（共30道题，答对24题为合格。测试时间为30分钟。）

客户姓名：\_\_\_\_\_ 答题日期：\_\_\_\_\_

客户身份证号码：\_\_\_\_\_ 答对题数：\_\_\_\_\_

一、判断题（本大题共10道小题，对的打“√”，错的打“X”，请将正确答案填入下面的表格中）

1	2	3	4	5	6	7	8	9	10

1. 中金所5年期国债期货合约采用集合竞价和连续竞价两种交易方式。（ ）
2. 期货交易必须在依法设立的期货交易所或者国务院期货监管机构批准的其他交易场所进行。（ ）
3. 股指期货合约的当日结算价是计算当日持仓盈亏的依据，沪深300股指期货合约以该合约当天收盘价作为当日结算价。（ ）
4. 中金所5年期国债期货的交割过程中，卖方具有选择对自己最有利的国债来交割的权利。（ ）
5. 交易所可以根据市场风险状况调整交易保证金标准，并向中国证券监督管理委员会报告。（ ）
6. 5年期国债期货交易，因市场出现异常情况等原因导致交割无法顺利进行的，交易所所有权对交割流程进行调整。（ ）
7. 中金所5年期国债期货限价指令每次最大下单数量为200手。（ ）

8. IF1007 合约表示的是 2010 年 7 月到期的沪深 300 股指期货合约。

( )

9. 期货公司向客户收取的交易保证金不得低于交易所规定的标准。

( )

10. 沪深 300 股指期货合约的最后交易日为合约到期月份的最后一个交易日，遇国家法定假日顺延。( )

二、单项选择题（本大题共 20 道小题，每题仅有一个正确答案，请将正确答案填入下面的表格中）

1	2	3	4	5	6	7	8	9	10
11	12	13	14	15	16	17	18	19	20

1. 中金所 5 年期国债期货合约的最小变动价位为：( )

- A. 0.001 元
- B. 0.0012 元
- C. 0.0015 元
- D. 0.002 元

2. 中金所 5 年期国债期货合约的报价方式为：( )

- A. 百元净价报价
- B. 千元净价报价
- C. 收益率报价
- D. 指数点报价

3. 在名义标准券设计之下, 中金所5年期国债期货采用: ( )
- A. 单一券种交收
  - B. 两种券种替代交收
  - C. 多券种替代交收
  - D. 以上都不是
4. 中金所5年期国债期货合约指令撮合时间为: ( )
- A. 9:04-9:05
  - B. 9:19-9:20
  - C. 9:09-9:10
  - D. 9:14-9:15
5. 中金所5年期国债期货合约交割方式为: ( )
- A. 现金交割
  - B. 实物交割
6. 国债期货是一种: ( )
- A. 利率风险管理工具
  - B. 汇率风险管理工具
  - C. 股票风险管理工具
  - D. 可以管理上述所有风险

- 7.中金所上市的5年期国债期货属于：（ ）
- A. 短期国债期货
  - B. 中期国债期货
  - C. 长期国债期货
  - D. 超长期国债期货合约
- 8.中金所5年期国债期货合约的面值为（ ）元人民币。
- A. 100万
  - B. 120万
  - C. 150万
  - D. 200万
- 9.中金所5年期国债期货合约票面利率为：（ ）
- A. 2.5%
  - B. 3%
  - C. 3.5%
  - D. 4%
- 10.中金所5年期国债期货合约对应的可交割国债是：（ ）
- A. 固定利率国债
  - B. 浮动利率国债
  - C. 固定或浮动利率国债
  - D. 以上都不是

11. 在极端行情下，股指期货投资者面临的亏损（ ）。
- A. 不可能超过投资本金
  - B. 可能会超过投资本金
12. 期货公司应当在（ ）向投资者揭示期货交易风险。
- A. 投资者开户前
  - B. 投资者开户后
  - C. 交易亏损时
13. 沪深 300 股指期货季月合约上市首日的涨跌停板幅度为该合约挂盘基准价的（ ）。
- A.  $\pm 6\%$
  - B.  $\pm 10\%$
  - C.  $\pm 20\%$
14. 假设某投资者当日只进行了两笔交易：以 3600 点买入开仓 2 手沪深 300 股指期货某合约后，以 3540 点卖出平仓 1 手该合约，如果当日该合约收盘价为 3560 点，结算价为 3550 点，而该投资者没有其他持仓且不考虑手续费，当日结算后其账户的亏损为（ ）。
- A. 33000 元
  - B. 30000 元
  - C. 3000 元

15. 甲投资者买入开仓 10 手沪深 300 股指期货某合约, 乙投资者卖出开仓 10 手, 甲乙恰好相互成交后, 市场上该合约的总持仓量将( )。

- A. 增加 10 手
- B. 增加 20 手
- C. 减少 10 手
- D. 没有变化

16. 证券公司受期货公司委托从事中间介绍业务, 不得提供下列何种服务( )。

- A. 协助办理开户手续
- B. 提供期货行情信息、交易设施
- C. 利用证券资金账户为客户存取、划转期货保证金

17. 某投资者欲在 3 个月后买入价值 1000 万元的股票组合, 担心 3 个月后股市上涨增加投资成本, 可采用的策略是( )。

- A. 买入股指期货进行套期保值
- B. 卖出股指期货进行套期保值
- C. 期现套利

18. 多头持仓是指( )后持有的未平仓头寸。

- A. 买入开仓
- B. 卖出开仓
- C. 买入平仓
- D. 卖出平仓

19. 欲参与股指期货交易的投资者开户时，需要与（ ）签署《期货经纪合同》。

- A. 期货交易所
- B. 期货保证金存管银行
- C. 期货公司

20. 以下关于沪深300股指期货市价指令，说法正确的是（ ）。

- A. 市价指令的成交价格可以超出涨跌停板价格范围
- B. 市价指令只能和限价指令撮合成交
- C. 集合竞价指令申报时间接受市价指令

---

### 客户承诺书

本人在此郑重承诺，以上题目均为本人回答。如答卷分数未达到标准或者由他人代答，本人自愿撤销本次开户申请。

承诺人（签字）：

期货公司开户知识测试人员（签字）：