

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年期国债期货合约的每日价格最大波动限制为 $\pm 3\%$ 。()
2. 中金所5年期国债期货合约的最低交易保证金为4%。()
3. 中金所5年期国债期货交易标的为票面利率为3.5%的中期国债。
()
4. 沪深300股指期货采用T+0交易制度。()
5. 中国金融期货交易所上市的沪深300股指期货合约的合约标的是上证综合指数。()
6. 股指期货某合约的价格与其所对应的标的指数走势无关。()
7. 沪深300股指期货市价指令未成交部分自动转为限价指令。()
8. 沪深300股指期货市价指令不需要申报买卖价格。()
9. 中金所5年期国债期货合约面值为100万元人民币。()
10. 中金所5年期国债期货的可交割国债应为在合约到期月份首日剩余期限为4至7年的国债。()

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

- 期货公司应当在（ ）向投资者揭示期货交易风险。
 - 投资者开户前
 - 投资者开户后
 - 交易亏损时
- 建立空头持仓应该下达（ ）指令。
 - 买入开仓
 - 买入平仓
 - 卖出开仓
 - 卖出平仓
- 沪深300股指期货交易中，单边市是指某一合约收市前（ ）分钟内出现只有停板价格的买入（卖出）申报、没有停板价格的卖出（买入）申报，或者一有卖出（买入）申报就成交、但未打开停板价格的情形。
 - 1
 - 5
 - 10

4. 沪深 300 股指期货交易实行持仓限额制度，进行投机交易的客户号某一合约单边持仓限额为（ ）。
- A. 100 手
 - B. 300 手
 - C. 600 手
5. 金融期货交易具有杠杆性，既放大盈利也放大亏损，是因为实行了（ ）。
- A. 双向交易制度
 - B. 保证金制度
 - C. 当日无负债结算制度
6. 金融期货交易的杠杆性决定了：收益可能成倍放大，损失也可能（ ）。
- A. 不变
 - B. 成倍缩小
 - C. 成倍放大
7. 金融期货投资者不得采用（ ）下达交易指令。
- A. 书面委托
 - B. 电话委托
 - C. 互联网委托
 - D. 全权委托期货公司

8. 在极端行情下，金融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
9. 客户在金融期货交易中发生保证金不足，且未能按照经纪合同中的约定及时追加保证金或者主动减仓，该客户部分或全部持仓将被（ ）。
- A. 强制减仓
 - B. 强行平仓
 - C. 协议平仓
10. 某交易日收盘后，某投资者持有1手沪深300股指期货某合约多单，该合约收盘价为3660点，结算价为3650点。下一交易日该投资者未进行任何操作，该合约的收盘价为3600点，结算价为3610点，结算后该笔持仓的当日亏损为（ ）。
- A. 18000元
 - B. 15000元
 - C. 12000元
11. 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

12. 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
13. 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%
14. 中金所5年期国债期货合约对应的可交割国债的剩余期限为:
()
- A. 距离合约交割月首日剩余期限为2至5年
 - B. 距离合约交割月首日剩余期限为3至6年
 - C. 距离合约交割月首日剩余期限为4至7年
 - D. 距离合约交割月首日剩余期限为5至8年
15. 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

16. 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
17. 中金所5年期国债期货的交易代码为：（ ）
- A. IF
 - B. IE
 - C. TF
 - D. TE
18. 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
19. 中金所5年期国债期货合约的最低交易保证金为：（ ）
- A. 合约价值 1%
 - B. 合约价值 1.5%
 - C. 合约价值 2%
 - D. 合约价值 2.5%

20. 中金所5年期国债期货合约的最后交易日为：()
- A. 合约到期月份第一个周五
 - B. 合约到期月份第二个周五
 - C. 合约到期月份第三个周五
 - D. 合约到期月份第四个周五

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):