# 金融期货基础知识测试试题（B 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. 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。（ ）
2. 沪深 300 股指期货合约的合约乘数为每点人民币 100 元。（ ）
3. 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. 期货公司应当在期货经纪合同中与客户约定风险管理的标准、条件及处置措施。（ ）
5. 沪深 300 股指期货合约的交割结算价为最后交易日该合约全天成交价按成交量的加权平均价。（ ）
6. 中金所 5 年期国债期货合约集合竞价时间中，9:10-9:14 为指令申报时间，9:14-9:15 为指令撮合时间。 （ ）
7. 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。（ ）

8. 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。（ ）

9. 中金所 5 年期国债期货合约的交割方式为现金交割。（ ）

10. 中金所 5 年期国债期货合约的每日价格最大波动限制为 ± 3%。（ ）

**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、股指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

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

A. 减少 10 手

B. 减少 20 手

C. 增加 10 手

D. 没有变化

3、客户出现交易所规定的异常交易行为并经劝阻、制止无效的，会员可以采取的措施不包括（　）。

A.　提高交易保证金

B.　限制开仓

C.　强制减仓

D.　拒绝客户委托或终止经纪关系

4、投资者以限价指令的方式卖出开仓沪深 300 股指期货某合约，申报价格为 3000 点，其成交价不可能为（　）点。

A.　3001

B.　3000

C.　2999

5、假设某投资者当日只进行了两笔交易：以 3600 点卖出开仓 2 手沪深 300 股指期货某合约，以 3640 点买入平仓 1 手该合约，当日该合约收盘价为 3660 点，结算价为 3650 点，如果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.　30000 元

B.　27000 元

C.　3000 元

6、沪深 300 股指期货合约的合约标的是（　　）。

A.　上证综合指数

B.　深证成份指数

C.　沪深 300 指数

7、只有取得中间介绍业务资格的（　）方可接受相应期货公司的委托，为该期货公司介绍客户参与股指期货交易。

A.　证券公司

B.　基金管理公司

C.　商业银行

8、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

9、沪深 300 股指期货投资者可以通过（　）建立的投资者查询服务系统查询其有关期货交易结算信息。

A.　中国期货保证金监控中心

B.　中国期货业协会

C.　中国金融期货交易所

10、沪深 300 股指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

11、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

12、中金所上市的首个国债期货产品为:（　）

A.　3 年期国债期货

B.　5 年期国债期货

C.　7 年国债期货

D.　10 年国债期货

13、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

14、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

15、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%

16、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 5.25 年

D.　距离合约交割月首日剩余期限为 5 至 8 年

17、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

18、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.　0.005 元

19、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

20、中金所 5 年期国债期货合约的交易标的采用:（　）

A.　名义标准券

B.　以具体券种为标的

C.　二者皆可

D.　二者都不是

————————————————————————————————

## 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）: