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 ±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

1. 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

2. 建立空头持仓应该下达（　）指令。

A. 买入开仓

B. 买入平仓

C. 卖出开仓

D. 卖出平仓

3. 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。

A. 1

B. 5

C. 10

4. 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

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）: