

## 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. 对中金所5年期国债期货进行交割, 客户在14:00前向交易所直接申报交割意向。( )
2. 中金所5年期国债期货市价指令每次最大下单数量为200手。( )
3. 中金所5年期国债期货交割中的配对缴款日, 交易所采用最小配对数原则进行交割配对, 并于当日14:30前将配对结果和应当缴纳的交割货款通知相关会员。( )
4. 交易所可以根据市场风险状况调整交易保证金标准。( )
5. 中金所5年期国债期货合约临近交割月份时, 交易所将分时间段逐步降低该合约的交易保证金标准。( )
6. 中金所可以根据市场风险状况调整沪深300股指期货合约的交易保证金标准。( )
7. 沪深300股指期货合约价值为沪深300指数点乘以合约乘数。( )
8. 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。( )

9. 股指期货实行 T+0 交易制度,当天建立的头寸可以当天平仓了结。

( )

10. 开盘价是指某一期货合约经集合竞价产生的成交价格,集合竞价未产生成交价格的,以集合竞价后第一笔成交价为开盘价。( )

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挂牌月份采用: ( )

- A. 12 个月循环
- B. 3、6、9、12 月中,距当前最近的 2 个季月
- C. 3、6、9、12 月中,距当前最近的 3 个季月
- D. 3、6、9、12 月中,距当前最近的 4 个季月

2. 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

3. 中金所5年期国债期货合约可交割国债的种类是：( )
- A. 实物国债
  - B. 储蓄国债
  - C. 记账式国债
  - D. 以上均可
4. 中金所5年期国债期货合约可交割国债必须符合：( )
- A. 仅可托管在银行间市场
  - B. 仅可托管在交易所市场
  - C. 可以同时托管在银行间和交易所市场
  - D. 以上均可
5. 中金所5年期国债期货转换因子在合约上市时公布，在合约存续期间其数值( )。
- A. 不变
  - B. 随时变化
  - C. 每月变动一次
  - D. 以上都不对
6. 中金所5年期国债期货合约每日价格最大波动限制为：( )
- A. 上一交易日结算价的 $\pm 1.2\%$
  - B. 上一交易日结算价的 $\pm 3\%$
  - C. 上一交易日结算价的 $\pm 4\%$
  - D. 上一交易日结算价的 $\pm 5\%$

7. 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1.5%
  - B. 合约价值1%
  - C. 合约价值2%
  - D. 合约价值2.5%
8. 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
9. 中金所5年期国债期货合约的最后交割日为：( )
- A. 最后交易日后第一个交易日
  - B. 最后交易日后第三个交易日
  - C. 最后交易日后第五个交易日
  - D. 最后交易日后第七个交易日
10. 中金所5年期国债期货的交易代码为：( )
- A. IF
  - B. IE
  - C. TF
  - D. TE

11. 沪深 300 股指期货某合约上一交易日结算价为 3000 点, 收盘价为 3100 点, 当日 (非最后交易日) 该合约的跌停板价格为 ( )。

- A. 2400 点
- B. 2700 点
- C. 2790 点

12. 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

13. 只有取得中间介绍业务资格的 ( ) 方可接受相应的期货公司委托, 为该期货公司介绍客户参与股指期货交易。

- A. 信托投资公司
- B. 商业银行
- C. 证券公司

14. 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

15. 根据股指期货投资者适当性制度,自然人投资者申请开户时保证金账户可用资金余额不低于人民币( )元。

- A. 20 万
- B. 50 万
- C. 100 万

16. 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

17. 参与股指期货交易的投资者要与( )签订期货经纪合同, 可以通过期货公司或具有中间介绍业务资格的证券公司及营业部办理具体的开户手续。

- A. 期货公司
- B. 证券公司
- C. 中国金融期货交易所

18. 某投资者卖出开仓沪深 300 股指期货某合约 10 手, 再买入平仓该合约 4 手后, 该投资者对该合约的持仓为( )。

- A. 4 手多单
- B. 6 手空单
- C. 10 手空单、4 手多单

19. 投资者带现金到期货公司办理入金手续, 但遭拒绝, 是因为( )。

- A. 期货公司只接受支票入金
- B. 投资者入金必须通过其期货结算账户和期货公司保证金账户间以同行转账的形式办理

20. 通过集合竞价买卖沪深 300 股指期货合约，交易指令的申报时间为 ( )。

- A. 9: 14-9: 15
- B. 9: 25-9: 29
- C. 9: 00-9: 10

---

### 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 ):