

2024 年期货从业资格之期货基础知识精选试题及答案二

单选题（共 40 题）

1、标准的美国短期国库券期货合约的面额为100 万美元，期限为90 天，最小价格波动幅度为一个基点(即 0.01%)，则利率每波动一点所带来的一份合约价格的变动为()美元。

- A. 25
- B. 32.5
- C. 50
- D. 100

【答案】 A

2、受聘于商品基金经理(CPO)，主要负责帮助 CPO 挑选商品交易顾问(CTA)，监督 CTA 交易活动的是（ ）。

- A. 介绍经纪商(IB)
- B. 托管人(Custodian)
- C. 期货佣金商(FCM)
- D. 交易经理(TM)

【答案】 D

3、由于期货结算机构的担保履约作用，结算会员及其客户可以随时对冲合约而不必征得原始对手的同意，使得期货交易的（ ）方式得以实施。

- A. 实物交割
- B. 现金结算交割
- C. 对冲平仓

D. 套利投机

【答案】 C

4、下列不属于反转形态的是()。

A. 双重底

B. 双重顶

C. 头肩形

D. 三角形

【答案】 D

5、3月1日，国内某交易者发现美元兑人民币的现货价格为6.1130，而6月份的美元兑人民币的期货价格为6.1190，因此该交易者以上述价格在CME卖出100手6月份的美元兑人民币期货，并同时在即期外汇市场换入1000万美元。4月1日，现货和期货价格分别变为6.1140和6.1180，交易者将期货平仓的同时换回人民币，从而完成外汇期现套利交易。则该交易

A. 盈利20000元人民币

B. 亏损20000元人民币

C. 亏损10000美元

D. 盈利10000美元

【答案】 A

6、3月31日，甲股票价格是14元，某投资者认为该股票近期会有小幅上涨。如果涨到15元，他就会卖出。于是，他决定进行备兑开仓，即以14元的价格买入5000股甲股票，同时以0.81元的价格卖出一份4月到期、行权价为15元（这一行权价等于该投资者对这只股票的心理卖出价位）的认购期权（假设合约单位为5000）。

A. 只能备兑开仓一份期权合约

- B. 没有那么多的钱缴纳保证金
- C. 不想卖出太多期权合约
- D. 怕担风险

【答案】 A

7、一般地，利率期货价格和市场利率呈()变动关系。

- A. 反方向
- B. 正方向
- C. 无规则
- D. 正比例

【答案】 A

8、下列关于我国境内期货强行平仓制度说法正确的是（ ）。

- A. 交易所以“强行平仓通知书”的形式向所有会员下达强行平仓要求
- B. 开市后，有关会员必须首先自行平仓，直至达到平仓要求，执行结果由期货公司审核
- C. 超过会员自行强行平仓时限而未执行完毕的，剩余部分由交易所直接执行强行平仓
- D. 强行平仓执行完毕后，由会员记录执行结果并存档

【答案】 C

9、看跌期权多头具有在规定时间内（ ）。

- A. 买入标的资产的潜在义务
- B. 卖出标的资产的权利
- C. 卖出标的资产的潜在义务

D. 买入标的资产的权利

【答案】 B

10、目前我国期货交易所采用的交易方式是（ ）。

A. 做市商交易

B. 柜台（OTC）交易

C. 公开喊价交易

D. 计算机撮合成交

【答案】 D

11、恒生指数期货合约的乘数为 50 港元。当香港恒生指数从 16000 点跌到 15990 点时，恒生指数期货合约的实际价格波动为（ ）港元。

A. 10

B. 500

C. 799500

D. 800000

【答案】 B

12、大连大豆期货市场某一合约的卖出价为 2100 元 / 吨，买入价为 2103 元 / 吨，前一成交价为 2101 元 / 吨，那么该合约的撮合成交价应为（ ）元 / 吨。

A. 2100

B. 2101

C. 2102

D. 2103

【答案】 B

13、沪深 300 股指期货合约交割方式为（ ）。

- A. 滚动交割
- B. 实物交割
- C. 现金交割
- D. 现金和实物混合交割

【答案】 C

14、基本面分析方法以供求分析为基础,研究价格变动的内在因素和根本原因,侧重于分析和预测价格变动的（ ）趋势。

- A. 长期
- B. 短期
- C. 中期
- D. 中长期

【答案】 D

15、对期权权利金的表述错误的是（ ）。

- A. 是期权的市场价格
- B. 是期权买方付给卖方的费用
- C. 是期权买方面临的最大损失（不考虑交易费用）
- D. 是行权价格的一个固定比率

【答案】 D

16、沪深 300 股指期货合约在最后交易日的涨跌停板幅度为（ ）

- A. 上一交易日结算价的±10%
- B. 上一交易日收盘价的±10%
- C. 上一交易日收盘价的±20%
- D. 上一交易日结算价的±20%

【答案】 D

17、某套利者在黄金期货市场上以 961 美元 / 盎司卖出一份 7 月份的黄金期货合约，同时他在该市场上以 950 美元 / 盎司买入一份 11 月份的黄金期货合约。若经过一段时间之后，7 月份价格变为 964 美元 / 盎司，同时 11 月份价格变为 957 美元 / 盎司，该套利者同时将两合约对冲平仓，套利的结果为盈利（ ）。

- A. -4 美元 / 盎司
- B. 4 美元 / 盎司
- C. 7 美元 / 盎司
- D. -7 美元 / 盎司

【答案】 B

18、榨油厂要在 3 个月后购买 191 吨大豆做原料，为套期保值，该厂需要购入（ ）手大豆期货。

- A. 190
- B. 19
- C. 191
- D. 19.1

【答案】 B

19、3 月 26 日，某交易者卖出 50 手 6 月甲期货合约同时买入 50 手 8 月该期货合约，价格分别为 2270 元 / 吨和 2280 元 / 吨。4 月 8 日，该交易者将所持头

寸全部平仓了结，6月和8月期货合约平仓价分别为2180元/吨和2220元/吨。该套利交易的盈亏状况是（ ）。(期货合约的交易单位每手10吨，不计手续费等费用)

- A. 亏损 15000 元
- B. 亏损 30000 元
- C. 盈利 15000 元
- D. 盈利 30000 元

【答案】 C

20、某交易者以260美分/蒲式耳的执行价格卖出10手5月份玉米看涨期权，权利金为16美分/蒲式耳，与此同时买入20手执行价格为270美分/蒲式耳的5月份玉米看涨期权，权利金为9美分/蒲式耳，再卖出10手执行价格为280美分/蒲式耳的5月份玉米看涨期权，权利金为4美分/蒲式耳。这种卖出蝶式套利的最大可能亏损是（ ）美分/蒲式耳。

- A. 4
- B. 6
- C. 8
- D. 10

【答案】 C

21、5月10日，7月份和8月份豆粕期货价格分别为3100元/吨和3160元/吨，套利者判断价差明显大于合理水平，下列选项中该套利者最有可能进行的交易是（ ）。

- A. 卖出7月豆粕期货合约同时买入8月豆粕期货合约
- B. 买入7月豆粕期货合约同时卖出8月豆粕期货合约
- C. 买入7月豆粕期货合约同时买入8月豆粕期货合约
- D. 卖出7月豆粕期货合约同时卖出8月豆粕期货合约

【答案】 B

22、某投资者做大豆期权的熊市看涨垂直套利，他买入敲定价格为 850 美分的大豆看涨期权，权力金为 14 美分，同时卖出敲定价格为 820 美分的看涨期权，权力金为 18 美分。则该期权投资组合的盈亏平衡点为（ ）美分。

A. 886

B. 854

C. 838

D. 824

【答案】 D

23、某加工商为了避免大豆现货价格风险，在大连商品交易所做买入套期保值，买入 10 手期货合约建仓，基差为-20 元 / 吨，卖出平仓时的基差为-50 元 / 吨，该工商在套期保值中的盈亏状况是（ ）元。大豆期货的交易单位是 10 吨/手。

A. 盈利 3000

B. 亏损 3000

C. 盈利 1500

D. 亏损 1500

【答案】 A

24、1 月，某购销企业与某食品厂签订合同，在两个月后以 3600 元 / 吨卖出 2000 吨白糖，为回避价格上涨风险，该企业买入 5 月份交割的白糖期货合约 200 手(每手 10 吨)，成交价为 4350 元 / 吨。至 3 月中旬，白糖现货价格已达 4150 元 / 吨，期货价格也升至 4780 元 / 吨。该企业采购白糖且平仓，结束套期保值。该企业在这次操作中（ ）。

A. 不盈不亏

B. 盈利

- C. 亏损
- D. 无法判断

【答案】 C

25、交易者在 1520 点卖出 4 张 S&P500 指数期货合约，之后在 1490 点全部平仓，该合约乘数为 250 美元，在不考虑手续费等交易成本的情况下，该笔交易（ ）美元。

- A. 盈利 7500
- B. 亏损 7500
- C. 盈利 30000
- D. 亏损 30000

【答案】 C

26、从持有交易头寸方向来看，期货市场上的投机者可以分为（ ）。

- A. 多头投机者和空头投机者
- B. 机构投机者和个人投机者
- C. 当日交易者和抢帽子者
- D. 长线交易者和短线交易者

【答案】 A

27、在我国，证券公司受期货公司委托从事中间介绍业务时，可以（ ）。

- A. 将客户介绍给期货公司
- B. 利用证券资金账户为客户存取、划转期货保证金
- C. 代理客户委托下达指令
- D. 代替客户签订期货经纪合同

【答案】 A

28、某投资公司持有的期货组合在置信度为 98%，期货市场正常波动情况下的当日 VaR 值为 1000 万元。其含义是（ ）。

- A. 该期货组合在下一个交易日内的损失在 1000 万元以内的可能性是 2%
- B. 该期货组合在本交易日内的损失在 1000 万元以内的可能性是 2%
- C. 该期货组合在本交易日内的损失在 1000 万元以内的可能性是 98%
- D. 该期货组合在下一个交易日内的损失在 1000 万元以内的可能性是 98%

【答案】 D

29、改革开放以来，（ ）标志着我国商品期货市场起步。

- A. 郑州粮食批发市场以现货交易为基础，引入期货交易机制
- B. 深圳有色金属交易所成立
- C. 上海金属交易所开业
- D. 第一家期货经纪公司成立

【答案】 A

30、可以同时银行间市场和交易所市场进行交易的债券品种是（ ）。

- A. 央票
- B. 企业债
- C. 公司债
- D. 政策性金融债

【答案】 B

以上内容仅为本文档的试下载部分，为可阅读页数的一半内容。如要下载或阅读全文，请访问：<https://d.book118.com/177010120002006060>