

2024 年期货从业资格之期货基础知识模考模拟试题 (全优)

单选题 (共 40 题)

1、某交易者在 1 月份以 150 点的权利金买入一张 3 月到期，执行价格为 10000 点的恒指看涨期权。与此同时，该交易者又以 100 点的权利价格卖出一张执行价格为 10200 点的恒指看涨期权。合约到期时，恒指期货价格上涨到 10300 点。

- A. -50
- B. 0
- C. 100
- D. 200

【答案】 B

2、下面 () 不属于波浪理论的主要考虑因素。

- A. 成交量
- B. 时间
- C. 高点、低点的相对位置
- D. 形态

【答案】 A

3、某投机者在 6 月以 180 点的权利金买入一张 9 月份到期、执行价格为 13000 点的股票指数看涨期权，同时他又以 100 点的权利金买入一张 9 月份到期、执行价格为 12500 点的同一指数看跌期权。从理论上讲，该投机者的最大亏损为 ()。

- A. 80 点
- B. 100 点

C. 180 点

D. 280 点

【答案】 D

4、某投资者开仓买入 10 手 3 月份的沪深 300 指数期货合约，卖出 10 手 4 月份的沪深 300 指数期货合约，其建仓价分别为 2800 点和 2850 点，上一交易日结算价分别为 2810 点和 2830 点，上一交易日该投资者没有持仓。如果该投资者当日不平仓，当日 3 月和 4 月合约的结算价分别为 2840 点和 2870 点，则该交易持仓盈亏为（ ）元。

A. -30000

B. 30000

C. 60000

D. 20000

【答案】 C

5、某只股票 β 为 0.8，大盘涨 10%，则该股票（ ）。

A. 上涨 8%

B. 上涨 10%

C. 下跌 8%

D. 下跌 10%

【答案】 A

6、如果看涨期权的卖方要对冲了结其期权头寸，应（ ）。

A. 卖出相同期限、相同月份且执行价格相同的看涨期权

B. 买入相同期限、相同月份且执行价格相同的看涨期权

- C. 卖出相同期限、相同月份且执行价格相同的看跌期权
- D. 买入相同期限、相同月份且执行价格相同的看跌期权

【答案】 B

7、以下属于持续形态的是（ ）。

- A. 矩形形态
- B. 双重顶和双重底形态
- C. 头肩形态
- D. 圆弧顶和圆弧底形态

【答案】 A

8、期现套利是利用（ ）来获取利润的。

- A. 期货市场和现货市场之间不合理的价差
- B. 合约价格的下降
- C. 合约价格的上升
- D. 合约标的的相关性

【答案】 A

9、在反向市场上，某交易者下达套利限价指令：买入5月菜籽油期货合约，卖出7月菜籽油期货合约，限价价差为40元/吨。若该指令成交，则成交的价差应（ ）元/吨。

- A. 小于或等于40
- B. 大于或等于40
- C. 等于40
- D. 大于40

【答案】 A

10、下列属于蝶式套利的有（ ）。

- A. 在同一期货交易所，同时买入 100 手 5 月份菜籽油期货合约、卖出 200 手 7 月份菜籽油期货合约、卖出 100 手 9 月份菜籽油期货合约
- B. 在同一期货交易所，同时买入 300 手 5 月份大豆期货合约、卖出 600 手 7 月份大豆期货合约、买入 300 手 9 月份大豆期货合约
- C. 在同一期货交易所，同时买入 300 手 5 月份豆油期货合约、买入 600 手 7 月份豆油期货合约、卖出 300 手 9 月份豆油期货合约
- D. 在同一期货交易所，同时买入 200 手 5 月份菜籽油期货合约、卖出 700 手 7 月份菜籽油期货合约、买入 400 手 9 月份铝期货合约

【答案】 B

11、1975 年 10 月，芝加哥期货交易所上市的（ ）期货，是世界上第一个利率期货品种。

- A. 欧洲美元
- B. 美国政府 10 年期国债
- C. 美国政府国民抵押协会（GNMA）抵押凭证
- D. 美国政府短期国债

【答案】 C

12、?在国外，股票期权执行价格是指（ ）。

- A. 标的物总的买卖价格
- B. 1 股股票的买卖价格
- C. 100 股股票的买卖价格
- D. 当时的市场价格

【答案】 B

13、根据下面资料，回答下题。

- A. 10
- B. 20
- C. -10
- D. -20

【答案】 C

14、某机构持有价值为 1 亿元的中国金融期货交易所 5 年期国债期货可交割国债，该国债的基点价值为 0.06045 元，5 年期国债期货（合约规模 100 万元）对应的最便宜可交割国债的基点价值为 0.06532 元，转换因子为 1.0373。根据基点价值法，该机构为对冲利率风险，应选用的交易策略是（ ）。

- A. 做多国债期货合约 89 手
- B. 做多国债期货合约 96 手
- C. 做空国债期货合约 96 手
- D. 做空国债期货合约 89 手

【答案】 C

15、期货保证金存管银行是由（ ）指定，协助交易所办理期货交易结算业务的银行。

- A. 证监会
- B. 交易所
- C. 期货公司
- D. 银行总部

【答案】 B

16、假设某一时刻股票指数为 2290 点，投资者以 15 点的价格买入一手股指看涨期权合约并持有到期，行权价格是 2300 点，若到期时股票指数期权结算价格跌落到 2310 点，投资者损益为（ ）。(不计交易费用)

- A. 5 点
- B. -15 点
- C. -5 点
- D. 10 点

【答案】 C

17、某投机者买入 CBOT30 年期国债期货合约，成交价为 98-175，然后以 97-020 的价格卖出平仓，则该投机者（ ）。

- A. 盈利 1550 美元
- B. 亏损 1550 美元
- C. 盈利 1484.38 美元
- D. 亏损 1484.38 美元

【答案】 D

18、对于某债券组合，三只债券投资额分别为 200 万元、300 万元和 500 万元，其久期分别为 3、4、5，则该债券组合的久期为（ ）。

- A. 1.2
- B. 4.3
- C. 4.6
- D. 5

【答案】 B

19、下列属于蝶式套利的有（ ）。

- A. 在同一期货交易所，同时买入 100 手 5 月份菜籽油期货合约、卖出 200 手 7 月份菜籽油期货合约、卖出 100 手 9 月份菜籽油期货合约
- B. 在同一期货交易所，同时买入 300 手 5 月份大豆期货合约、卖出 600 手 7 月份大豆期货合约、买入 300 手 9 月份大豆期货合约
- C. 在同一期货交易所，同时买入 300 手 5 月份豆油期货合约、买入 600 手 7 月份豆油期货合约、卖出 300 手 9 月份豆油期货合约
- D. 在同一期货交易所，同时买入 200 手 5 月份菜籽油期货合约、卖出 700 手 7 月份菜籽油期货合约、买入 400 手 9 月份铝期货合约

【答案】 B

20、在我国的期货交易所中，实行公司制的是（ ）。

- A. 郑州商品交易所
- B. 大连商品交易所
- C. 上海期货交易所
- D. 中国金融期货交易所

【答案】 D

21、期货交易所会员每天应及时获取期货交易所提供的结算数据，做好核对工作，并将之妥善保存，该数据应至少保存（ ），但对有关期货交易有争议的，应当保存至该争议消除时为止。

- A. 1 年
- B. 2 年
- C. 10 年

D. 20 年

【答案】 B

22、棉花期货的多空双方进行期转现交易。多头开仓价格为 10210 元 / 吨，空头开仓价格为 10630 元 / 吨，双方协议以 10450 元 / 吨平仓，以 10400 元 / 吨进行现货交收，若棉花的交割成本 200 元 / 吨，进行期转现后，多空双方实际买卖价格为()。

A. 多方 10160 元 / 吨，空方 10580 元 / 吨

B. 多方 10120 元 / 吨，空方 10120 元 / 吨

C. 多方 10640 元 / 吨，空方 10400 元 / 吨

D. 多方 10120 元 / 吨，空方 10400 元 / 吨

【答案】 A

23、美国在 2007 年 2 月 15 日发行了到期日为 2017 年 2 月 15 日的国债，面值为 10 万美元，票面利率为 4.5%。如果芝加哥期货交易所某国债期货（2009 年 6 月到期，期限为 10 年）的卖方用该国债进行交割，转换因子为 0.9105，假定 10 年期国债期货 2009 年 6 月合约交割价为 125-160，该国债期货合约买方必须付出（ ）美元。

A. 116517.75

B. 115955.25

C. 115767.75

D. 114267.75

【答案】 C

24、平值期权和虚值期权的时间价值（ ）零。

A. 大于

B. 大于等于

C. 等于

D. 小于

【答案】 B

25、2006年9月，（ ）成立，标志着中国期货市场进入商品期货与金融期货共同发展的新阶段。

A. 中国期货保证金监控中心

B. 中国金融期货交易所

C. 中国期货业协会

D. 中国期货投资者保障基金

【答案】 B

26、目前，货币政策是世界各国普遍采用的经济政策，其核心是对（ ）进行管理。

A. 货币供应量

B. 货币存量

C. 货币需求量

D. 利率

【答案】 A

27、期货公司对营业部实行“四统一”，即统一结算、统一风险管理、统一财务管理和会计核算、统一（ ）。

A. 资金管理

B. 资金调拨

C. 客户管理

D. 交易管理

【答案】 B

28、股票期货合约的净持有成本为（ ）。

A. 储存成本

B. 资金占用成本

C. 资金占用成本减去持有期内股票分红红利

D. 资金占用成本加上持有期内股票分红红利

【答案】 C

29、规范化的期货市场产生地是（ ）。

A. 美国芝加哥

B. 英国伦敦

C. 法国巴黎

D. 日本东京

【答案】 A

30、20 世纪 70 年代初，（ ）的解体使得外汇风险增加。

A. 布雷顿森林体系

B. 牙买加体系

C. 葡萄牙体系

D. 以上都不对

【答案】 A

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/206011152002010110>