

# 2024 年期货从业资格之期货基础知识题库检测试卷

## B 卷附答案

单选题（共 40 题）

1、下列关于跨品种套利的论述中，正确的是（ ）

- A. 跨品种套利只能进行农作物期货交易
- B. 互补品之间可以进行跨品种套利，但是互为替代品之间不可以
- C. 利用两种或三种不同的但相互关联的商品之间的期货合约价格差异进行套利
- D. 原材料和成品之间的套利在中国不可以进行

【答案】 C

2、当客户的可用资金为负值时，（ ）。

- A. 期货交易所将第一时间对客户实行强行平仓
- B. 期货公司将第一时间对客户实行强行平仓
- C. 期货公司将首先通知客户追加保证金或要求客户自行平仓
- D. 期货交易所将首先通知客户追加保证金或要求客户自行平仓

【答案】 C

3、6 月 5 日，某客户开仓卖出我国大豆期货合约 40 手，成交价格 4210 元/吨，当天平仓 20 手合约，成交价格为 4220 元/吨，当日结算价格 4225 元/吨，交易保证金比例为 5%，则该客户当天合约占用的保证金为（ ）元。（交易单位为 10 吨/手）

- A. 42250
- B. 42100
- C. 4210
- D. 4225

【答案】 A

4、在中国境内，参与金融期货与股票期权交易前需要进行综合评估的是（）。

- A. 基金管理公司
- B. 商业银行
- C. 个人投资者
- D. 信托公司

【答案】 C

5、某套利者以 461 美元/盎司的价格买入 1 手 12 月的黄金期货，同时以 450 美元/盎司的价格卖出 1 手 8 月的黄金期货。持有一段时间后，该套利者以 452 美元/盎司的价格将 12 月合约卖出平仓，同时以 446 美元/盎司的价格将 8 月合约买入平仓。该套利交易的盈亏状况是（）美元/盎司。

- A. 亏损 5
- B. 获利 5
- C. 亏损 6
- D. 亏损 7

【答案】 A

6、某新客户存入保证金 30 000 元，5 月 7 日买入 5 手大豆合约，成交价为 4000 元/吨，当日结算价为 4020 元/吨，5 月 8 日该客户又买入 5 手大豆合约，成交价为 4030 元/吨，当日结算价为 4060 元/吨。则该客户在 5 月 8 日的当日盈亏为（）元。（大豆期货 10 吨/手）

- A. 450
- B. 4500
- C. 350

D. 3500

【答案】 D

7、假设某投资者持有 A、B、C 三种股票，三种股票的  $\beta$  系数分别是 0.9，1.2 和 1.5，其资金分配分别是 100 万元、200 万元和 300 万元，则该股票组合的  $\beta$  系数为（ ）。

A. 1.5

B. 1.3

C. 1.25

D. 1.05

【答案】 B

8、无本金交割外汇 (NDF) 交易属于() 交易。

A. 外汇掉期

B. 货币互换

C. 外汇期权

D. 外汇远期

【答案】 D

9、中国外汇交易中心公布的人民币汇率所采取的是（ ）。

A. 单位镑标价法

B. 人民币标价法

C. 直接标价法

D. 间接标价法

【答案】 C

10、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**

11、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. 4000

B. 4050

C. 4100

D. 4150

**【答案】 B**

12、当市场价格达到客户预先设定的触发价格时，即变为限价指令予以执行的指令是()。

A. 取消指令

B. 止损指令

C. 限时指令

D. 阶梯价格指令

【答案】 B

13、美国中长期国债期货报价由三部分组成，第二部分采用（ ）进位制。

A. 2

B. 10

C. 16

D. 32

【答案】 D

14、关于股票价格指数期权的说法，正确的是（ ）。

A. 采用现金交割

B. 股指看跌期权给予其持有者在未来确定的时间，以确定的价格买入确定数量股指的权利

C. 投资比股指期货投资风险小

D. 只有到期才能行权

【答案】 A

15、利用股指期货可以（ ）。

A. 进行套期保值，降低投资组合的系统性风险

B. 进行套期保值，降低投资组合的非系统性风险

C. 进行投机，通过期现市场的双向交易获取超额收益

D. 进行套利，通过期货市场的单向交易获取价差收益

【答案】 A

16、某日，我国某月份铜期货合约的结算价为 59970 元/吨，收盘价为 59980 元/吨，若每日价格最大波动限制为±4%，铜的最小变动价为 10 元/吨，同一交割日（ ）元/吨为无效报价。

A. 62380

B. 58780

C. 61160

D. 58790

**【答案】 A**

17、介绍经纪商这一称呼源于（ ），在国际上既可以是机构，也可以是个人，但一般都以机构的形式存在。

A. 中国

B. 美国

C. 英国

D. 日本

**【答案】 B**

18、期货市场（ ）方法是通过对市场行为本身的分析来预测价格的变动方向。

A. 供求分析

B. 宏观经济分析

C. 基本面分析

D. 技术分析

**【答案】 D**

19、机构投资者能够使用股指期货实现各类资产配置策略的基础在于股指期货具备两个非常重要的特性：一是能获取高额的收益，二是具备（ ）功能。

- A. 以小博大
- B. 套利
- C. 投机
- D. 风险对冲

【答案】 D

20、在我国，某交易者3月3日买入10手5月铜期货合约的同时卖出10手7月铜期货合约，价格分别为45800元/吨和46600元/吨；3月9日，该交易者对上述合约全部对冲平仓，5月和7月平仓价格分别为46800元和47100元/吨。铜期货合约的交易单位为5吨/手，该交易者盈亏状况是（ ）元。（不计手续费等其他费用）

- A. 亏损 25000
- B. 盈利 25000
- C. 盈利 50000
- D. 亏损 50000

【答案】 B

21、对于技术分析理解有误的是（ ）。

- A. 技术分析提供的量化指标可以警示行情转折
- B. 技术分析可以帮助投资者判断市场趋势
- C. 技术分析方法是价格变动的根本原因的判断
- D. 技术分析方法的特点是比较直观

【答案】 C

22、关于交割等级，以下表述错误的是（ ）。

- A. 交割等级是由期货交易所统一规定的，准许在交易所上市交易的合约标的物的质量等级
- B. 在进行期货交易时，交易双方无须对标的物的质量等级进行协商，发生实物交割时按交易所期货合约规定的标准质量等级进行交割
- C. 替代品的质量等级和品种，一般由买卖双方自由决定
- D. 用替代品进行实物交割时，价格需要升贴水

【答案】 C

23、对买入套期保值而言，基差走强，套期保值效果是（ ）。（不计手续费等费用）

- A. 期货市场和现货市场不能完全盈亏相抵，存在净亏损
- B. 期货市场和现货市场能完全盈亏相抵且有净盈利
- C. 现货市场盈利完全弥补期货市场亏损，完全实现套期保值
- D. 以上说法都不对

【答案】 A

24、关于期货公司的说法，正确的是（ ）。

- A. 在公司股东利益最大化的前提下保障客户利益
- B. 客户的保证金风险是期货公司重要的风险源
- C. 属于银行金融机构
- D. 主要从事经纪业务，不提供资产管理服务

【答案】 B

25、某套利者在4月1日买入7月铝期货合约的同时卖出8月铝期货合约，价格分别为13420元/吨和13520元/吨，持有一段时间后，价差扩大的情形是（ ）。

- A. 7月期货合约价格为13460元/吨，8月份期货合约价格为13500元/吨
- B. 7月期货合约价格为13400元/吨，8月份期货合约价格为13600元/吨
- C. 7月期货合约价格为13450元/吨，8月份期货合约价格为13400元/吨
- D. 7月期货合约价格为13560元/吨，8月份期货合约价格为13300元/吨

**【答案】 B**

26、王某开仓卖出大豆期货合约20手（每手10吨），成交价格为2020元/吨，当天结算价格为2040元/吨，交易保证金比例为5%，因此结算后占用的保证金为（ ）元。

- A. 20400
- B. 20200
- C. 10200
- D. 10100

**【答案】 A**

27、某投资者共购买了三种股票A、B、C占用资金比例分别为30%、20%、50%，A、B股票相对于某个指数而言的 $\beta$ 系数为1.2和0.9。如果要使该股票组合的 $\beta$ 系数为1，则C股票的 $\beta$ 系数应为（ ）。

- A. 0.91
- B. 0.92
- C. 1.02
- D. 1.22

**【答案】 B**

28、3月中旬，某饲料厂预计两个月后将需要玉米5000吨，决定利用玉米期货进行套期保值。该厂在7月份到期的玉米期货合约上建仓，成交价格为2060元/吨。此时玉米现货价格为2000元/吨。至5月中旬，玉米期货价格上涨至2190元/吨，玉米现货价格为2080元/吨。该饲料厂按照现货价格买入5000吨玉米，同时按照期货价格将7月份玉米期货合约对冲平仓。则套期保值的结果为（ ）。

- A. 基差不变，实现完全套期保值
- B. 基差走弱，不完全套期保值，存在净盈利
- C. 基差走强，不完全套期保值，存在净盈利
- D. 基差走强，不完全套期保值，存在净亏损

【答案】 B

29、（ ）是指在交易所交易池内由交易者面对面地公开喊价，表达各自买进或卖出合约的要求。

- A. 计算机撮合成交
- B. 连续竞价制
- C. 一节一价制
- D. 交易者协商成交

【答案】 B

30、关于股指期货套利行为描述错误的是（ ）。

- A. 不承担价格变动风险
- B. 提高了股指期货交易的活跃程度
- C. 有利于股指期货价格的合理化
- D. 增加股指期货交易的流动性

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/255012313002011132>