
选择题：

- 1：投资者参与金融期货交易，应当遵循（**买卖自负**）原则，不得以不符合适当性标准为由，拒绝承担交易结果与履约责任。
- 2：某投资者欲在 3 个月后买入价值 1000 万元的股票组合，担心 3 个月后股市上涨增加投资成本，可采用的策略是（**买入套保**）。
- 3：不属于交易所规定的异常交易行为的是（**同一客户在多家期货公司开户**）。
- 4：参与金融期货交易的投资者应与（**期货公司**）签订期货经纪合同。
- 5：以下属于影响股指期货价格的宏观经济因素是（**居民物价消费指数（CPI）**）。
- 6 国债期货合约进入交割月份后至最后交易日前（**卖方可以主动提出交割申报，交易所匹配双方在规定时间内完成交割**）。
- 7：除最后交易日外，中金所 5 年期、10 年期国债期货交易时间为交易日（**9:15-11:30；13:00-15:15**）。
- 8：某投资者欲在上证 50 股指期货 2 月合约上买入开仓 5 手，却误买入 3 月合约，该风险属于（**操作风险**）。
- 9：投资者申请开通金融期货交易权限，其保证金账户可用资金余额以（**期货公司**）收取的保证金标准作为计算依据。
- 10：（**交易会员**）不具备直接与中国金融期货交易所进行结算的资格。
- 11：中金所国债期货合约可交割国债的种类是（**记账式国债**）。
- 12：中金所 5 年期国债期货合约的最后交割日为（**最后交易日后第三个交易日**）。
- 13：股指期货合约的交割结算价为最后交易日标的指数（**全天的算术平均价**）。
- 14：国债期货投机，是通过买卖国债期货合约，并从其价格变动中获得（**风险收益**）的交易行为。

15：中金所 5 年期、10 年期国债期货交割涉及的托管业务，(**可以在中央国债登记结算有限责任公司或中国证券登记结算有限责任公司办理**)。

16：自然人投资者申请开立金融期货交易编码，应当连续 5 个交易日每日日终保证金账户可用资金余额不低于人民币 (**50**) 万元。

17：以下选项中关于中金所 5 年期、10 年期国债期货限价指令说法正确的是(**限价指令可以按限定价格或更优价格成交**)。

18：(**信息告知、风险警示、适当性匹配**) 属于普通投资者享有的特别保护。

19：关于中金所 5 年期、10 年期国债期货交割流程描述不正确的是 (**最后交易日前进入交割的，以中金所认定的机构指定的国债作为基准国债**)。

20：属于国债期货空头套期保值的情形是(**持有债券现货多仓和国债期货空仓**)。

21：中金所国债期货结算，按照当日 (**结算价**) 对结算会员所有合约的盈亏、交易保证金及手续费、税金等费用进行清算。

22：股指期货合约到期时，采用 (**现金交割**)。

23：某投资者欲在中证 500 股指期货 6 月合约上买入开仓 1 手，但实际操作为该合约卖出开仓 1 手，该风险属于 (**操作风险**)。

24：建立金融期货多头持仓应该下达 (**买入开仓**) 指令。

25：空头持仓是指 (**卖出开仓**) 后持有的未平仓头寸。

26：通常情况下，利率上升，国债期货价格将 (**下降**)。

27：股指期货套期保值可以规避股票市场的 (**系统性风险**)。

28：开通金融期货权限，自然人投资者应当具有累计 (**10**) 个交易日、20 笔及以上金融期货仿真交易经历。

29：中金所国债期货交割流程中，卖方交券日为 (**第一交割日**)。

-
- 30：上证 50 股指期货合约标的是（**上证 50 指数**）。
- 31：以下情形中，适宜进行国债期货多头套期保值的是（**计划三个月后买入国债**）。
- 32：股指期货交易的对象是（**股指期货合约**）。
- 33：如果投资者预测股票指数后市将上涨而买进股指期货合约，这种操作属于（**多头投机**）。
- 34：以下关于中金所以对 10 年期国债期货合约投机客户持仓限额的规定，正确的是（**随着合约剩余期限的缩短，交易所会下调持仓限额**）。
- 35：国债期货价格主要基于对（**利率**）变动的预期。
- 36：一般单位客户申请开户前连续 5 个交易日保证金账户可用资金余额不低于人民币（**50**）万元。
- 37：若中证 500 指数期货 9 月合约上一日的结算价为 6000 点，涨跌停板幅度为 10%，则下一交易日的跌停板价格为（**5400**）点。
- 38：开通金融期货交易权限，（**自然人**）应通过金融期货知识测试。
- 39：中金所 5 年期国债期货合约的报价方式为（**百元净价报价**）。
- 40：中金所 5 年期国债期货的当日结算价为最后（**一小时**）成交价格按照成交量的加权平均值。
- 41：某投资者以 3500 点卖出开仓 1 手沪深 300 指数期货某合约，合约乘数为每点 300 元，当日该合约结算价为 3560 点，若不考虑手续费，当日结算后该笔持仓浮动（**亏损 18000 元**）。
- 42：中金所国债期货交割流程中，以一般模式进行交割的，买方缴款日为（**第二交割日**）。

-
- 43：股指期货（套期保值）是规避股票市场系统性风险的工具。
- 44：中金所5年期国债期货交易采用（中期）“名义标准债券”作为交易标的。
- 45：中金所国债期货合约临近交割月份时，（交易所将分时间段逐步提高）合约的交易保证金标准。
- 46：中国金融期货交易所实行套期保值额度管理制度，客户申请套期保值额度的，应当首先向（客户开户的期货公司）提交材料。
- 47：关于中金所5年期、10年期国债期货国债托管账户的描述错误的是（参与交割的客户应当事先自行向交易所申报国债托管账户）。
- 48：不属于国债期货合约主要条款的是（保证金存管银行）。
- 49：期货公司可以接受客户（指令下达人）发出的交易指令。
- 50：国债期货投机交易面临的风险通常不包括（违约风险）。
- 51：开通金融期货交易权限前，期货公司应当向投资者充分揭示金融期货的（交易风险）。
- 52：在极端行情下，金融期货投资者面临的亏损（可能会超过初始投资本金）。
- 53：关于中金所5年期、10年期国债期货交割流程描述正确的是（均采用交易所认定的机构指定的国债作为基准国债）。
- 54：证券公司受期货公司委托从事中间介绍业务，不得提供下列（利用证券资金账户为客户存取、划转期货保证金）服务。
- 55：中金所5年期国债期货的交割结算价为（最后交易日全天成交量加权平均价）。
- 56：期货公司收取投资者的保证金，一般会在交易所要求的保证金基础上（上浮一定比率）。

57 :某投资者买入开仓 1 手中证 500 指数期货某合约 ,该合约乘数每点 200 元。当日该合约的结算价为 3000 点 ,假设保证金率为 20% ,则当日该笔持仓需保证金 (120000) 元。

58 : 中金所 10 年期国债期货的可交割券为 (合约到期月份首日剩余期限为 6.5-10.25 年) 的记账式付息国债。

59 : 目前 , 金融期货合约在 (中国金融期货交易所) 交易。

60 : 通常情况下 , 货币供应量减少 , 国债期货价格将 (下跌)。

61 : 投资者买入某股指期货合约后 , 该合约价格下跌 , 这类风险属于 (市场风险)。

62 : 买进国债现货同时卖出国债期货属于 (套期保值) 交易。

63 : 关于中金所国债期货交割单位说法错误的是 (每交割单位的国债可以来自不同国债托管机构的不同国债)。

64 : 中金所 10 年期国债期货合约标的为 (名义长期国债)。

65 : 买进股票组合的同时卖出相同数量的股指期货合约是 (买入套期保值)。

66 : 关于股指期货合约 , 说法错误的是 (交割日为最后交易日的下一交易日)。

67 : 对于沪深 300 股指期货 , 说法正确的是 (市价指令申报时无需指定价格)。

68 : 某沪深 300 指数期货合约 1 手的价值为 120 万元 , 合约乘数为每点 300 元 , 则该合约的成交价为 (4000) 点。

69 : (市价指令) 属于中金所规定的国债期货交易指令。

70 : 股指期货合约到期时 , 只能进行 (实物交割)。

71 : 国债期货套期保值的目的是为规避 (利率风险)。

72 : 股指期货的交易保证金率由 15% 提高到 20% , 则参与股指期货交易的 (杠

杆变小)。

73：股指期货合约到期交割时，根据到期合约的(交割结算价)计算持仓双方的盈亏金额。

74：影响股指期货价格的主要因素是(利率下降)。

75：股指期货的市价指令在申报时无需指定价格，按照(当时市场上可执行的最优报价)成交。

76：金融期货投资者不得采用(全权委托期货公司)方式下达交易指令。

77：关于中金所对国债期货合约投机客户持仓限额的规定，(随着合约剩余期限的缩短，交易所会下调持仓限额)。

78：中金所发布的股指期货合约的持仓量是其未平仓合约的(单边)数量。

79：利用上证 50 和沪深 300 股指期货进行价差交易，属于(跨品种套利)。

80：中金所 5 年期、10 年期国债期货(采用连续竞价和集合竞价)。

81：属于国债期货多头套期保值的情形是(买入国债期货代替现货)。

82：我国国债期货合约是(中国金融期货交易所制定的)。

83：交易所对存在异常交易行为的客户采取有关监管措施或者做出相关书面决定的，通过(客户所在期货公司)向客户发出。

84：关于中金所 10 年期国债期货合约转换因子的表述，正确的是(将面值 100 元的可交割债券在其剩余期限内的现金流，用 3% 的标准券年息票率所折成的现值)。

85：中金所 5 年期、10 年期国债期货自交割月份之前的第二个交易日起至最后交易日之前一个交易日，每日收市后，(同一交易编码的交割月份合约双向持仓对冲平仓，平仓价格为该合约当日结算价)。

86：沪深 300 股指期货某合约的价格为 3050 点，合约乘数为每点 300 元，则一手该合约的价值为 (91.5) 万元。

87：开通金融期货交易，要求投资者提供 (仿真交易经历)。

88：如果股指期货价格高于股票组合价格，并且两者差额大于套利成本，可 (卖出股指期货合约，同时买入股票组合)。

89：国债期货的标的采用名义标准券，可以扩大可交割国债的范围，(减小交割时的逼仓风险)。

90：中金所 5 年期国债期货合约标的为 (名义中期国债)。

91：某投资者欲在沪深 300 股指期货 6 月合约上买入开仓 5 手，在选择合约时错误地选择了 9 月合约，该风险属于 (操作风险)。

92：预期市场利率上升，投资者适宜采取 (卖出国债期货) 策略。