

2010 年期货从业资格考试基础知识题目

一、单项选择题

1. 期货投资基金业最发达的国家是（ ）。
A. 英国
B. 比利时
C. 美国
D. 日本
2. 在期货交易中，（ ）承担的风险是由于基差的不利变动引起的。
A. 期货交易所
B. 期货公司
C. 投机者
D. 套期保值者
3. （ ）是指由于交易对手不履行履约责任而导致的一种风险。
A. 操作风险
B. 信用风险
C. 流动性风险
D. 法律风险
4. 如果追加数量很小的需求可以使价格大幅度上涨，那么这个期货市场就是（ ）。
A. 有广度的
B. 窄的
C. 缺乏深度的
D. 有深度的
5. 以下并非期货市场风险成因的是（ ）。
A. 价格波动
B. 杠杆效应
C. 市场机制不健全
D. 理性投机
6. 美国商品期货交易委员会(CFTC)管理整个美国的期货行业，重点管理范围不包括（ ）。

- A.交易所
- B.投资者
- C.期货经纪商
- D.交易所会员

7.某玉米看涨期权合约中的执行价格为 3.50 美元/蒲式耳,而当时玉米期货合约价格为 3.60 美元/蒲式耳,则该期权肯定为()。

- A.实值期权
- B.虚值期权
- C.两平期权
- D.欧式期权

8.某投机者的交易情况如下表所示:

某投机者的交易情况

8月20日卖出1份11月份大豆看涨期权合约

执行价格700美分/蒲式耳

权利金6美分/蒲式耳买进1份12月份大豆看涨期权合约

执行价格700美分/蒲式耳

权利金9美分/蒲式耳9月20日买进1份11月份大豆看涨期权合约

执行价格700美分/蒲式耳

权利金8美分/蒲式耳卖出1份12月份大豆看涨期权合约

执行价格700美分/蒲式耳

权利金12美分/蒲式耳则在此次套利交易中,该投机者盈利()美分/蒲式耳。

- A.1
- B.2
- C.3
- D.4

9.投资基金中历史最长的一类基金是()。

- A.共同基金
- B.对冲基金
- C.期货投资基金
- D.证券投资基金

10.帮助商品基金经理挑选商品交易顾问是（ ）的主要职责之一。

- A.期货佣金商
- B.交易经理
- C.托管者
- D.基金投资者

二、多项选择题

1.在基金单位赎回过程中，涉及的内容有（ ）。

- A.赎回价格
- B.赎回程序
- C.短期交易费用
- D.赎回条件

2.期货投资基金风险控制的具体内容包括（ ）。

- A.风险测量
- B.风险控制的原则和目标
- C.风险管理方法
- D.投资限制

3.下列不属于期货投资基金监管模式的是（ ）。

- A.国家严格统一监管模式
- B.行业自律组织监管模式
- C.会员自律监管模式
- D.个人自律管理模式

4.下列会造成期货市场流动性降低的是（ ）

- A.期货价格呈连续单边走势
- B.大量的新交易者进入市场
- C.大量的交易者退出市场
- D.交割月临近

5.在不可控风险中，宏观环境变化的风险主要由（ ）变动引起。

- A.不可抗力的自然因素
- B.政治因素

C.政策因素

D.社会因素

6.期货市场的流动性风险可分为（ ）。

A.资金量风险

B.流通量风险

C.汇率风险

D.利率风险

7.客户可以采用（ ）来防范期货市场风险。

A.充分了解和认识期货交易的基本特点

B.慎重选择期货公司

C.制定正确的投资战略，将风险控制在自己可以承受的范围

D.规范自身行为，提高风险意识和心理承受能力

8.对期货公司从业人员提高业务技能方面的管理要求有（ ）。

A.熟悉业务流程

B.帮助客户分析行情

C.减少操作失误

D.为客户决策

9.关于期权分类，下列说法正确的是（ ）。

A.按标的物不同，可分为现货期权与期货期权

B.按交易内容不同，可分为看涨期权与看跌期权

C.按行使权利的期限不同，可分为美式期权和欧式期权

D.按交易单位不同，可分为同一种期权和同一系列期权

10.企业在运用货币期权来套期保值时，正确的做法是（ ）。

A.当企业有应付外币账款时，买入看涨期权

B.当企业有应收外币账款时，买入看涨期权

C.当企业有应付外币账款时，买入看跌期权

D.当企业有应收外币账款时，买入看跌期权

三、判断题

- 1.理性(正常)价格波动引起的风险的大小一般是在一定的范围内,而非理性(异常)价格波动造成的风险大小,则难以估量其范围。()
- 2.期货市场的行政管理在期货市场的三个层次管理中处于核心和基础地位。()
- 3.在一个平稳的市场状况中,期货投资基金的基金经理们也可以通过投资组合获得获利机会。()
- 4.私募期货基金的有限合伙人只需投入很少比例的资金,但要参加基金的具体交易和日常管理活动。()
- 5.“多CTA投资组合”的方差比单个CTA的方差小,多CTA投资策略能在相同的回报率水平下,降低投资者的风险水平。()
- 6.市场机制不健全是造成期货价格非理性波动最直接、最核心的因素。()
- 7.如果追加数量很小的需求可以使价格大幅度上涨,那么,市场就有广度。()
- 8.经中国期货业协会同意,结算所可以运用其他会员或客户除了风险基金之外的保证存款,去填补某一会员无力偿付的债项。()
- 9.共同基金大量运用卖空机制,并且大量使用信贷杠杆进行高于自己本金数倍甚至数十倍的高风险投机操作。()
- 10.私募期货基金的投资者和经理人共同构成基金的合伙人,其中,投资者是有限合伙人,经理人为一般合伙人。()

参与期货从业考试的考生可按照复习计划有效进行,另外高顿网校官网考试辅导高清课程已经开通,还可索取证券考试通关宝典,针对性地讲解、训练、答疑、模考,对学习过程进行全程跟踪、分析、指导,可以帮助考生全面提升备考效果。更多详情可登录高顿网校官网进行咨询。

更多期货从业资格考试资讯,请关注高顿网校官方微信号:gaoduneclass