

历年真题：期货基础知识考试真题汇编 14

1、近一段时间来，9 月份黄豆的最低价为 2280 元/吨，达到最高价 3460 元/吨后开始回落，则根据百分比线，价格回落到()左右后，才会开始反弹。

- A、2673 元/吨
- B、3066 元/吨
- C、2870 元/吨
- D、2575 元/吨

答案：A

2、某金矿公司公司预计三个月后将出售黄金，故先卖出黄金期货，价格为 298 美元，出售黄金时的市价为 308 美元，同时以 311 美元回补黄金期货，其有效黄金售价为()。

- A、308 美元
- B、321 美元
- C、295 美元
- D、301 美元

答案：C

3、某投机者在 6 月份以 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、某大豆交易者在现货价与期货价分别为 50.50 元和 62.30 元时，买入期货来规避大豆涨价的风险，最后在基差为-18.30 时平仓，该套期保值操作的净损益为()。

- A、11.80 元
- B、-11.80 元
- C、6.50 元
- D、-6.50 元

答案：C

5、已知最近二十天内，5 月份强筋麦的最高价为 2250 元/吨，最低价为 1980 元/吨，昨日的 K 值为 35，D 值为 36，今日收盘价为 2110 元/吨，则 20 日 RSV 值为()，今天 K 值为()，今日 D 值为()，今日 J 值为()。

- A、28，32，41，33
- B、44，39，37，39
- C、48，39，37，33
- D、52，35，41，39

答案：C

6、若 6 月 S&P500 期货买权履约价格为 1100，权利金为 50，6 月期货市价为 1105，则()。

- A、时间价值为 50
- B、时间价值为 55
- C、时间价值为 45
- D、时间价值为 40

答案：C

7、某投资者以\$340/盎司买入黄金期货，同时卖出履约价为\$345/盎司的看涨期权，权利金为\$5/盎司，则其最大损失为()。

- A、\$5/盎司
- B、\$335/盎司
- C、无穷大
- D、0

答案：B

8、CBOT 是美国最大的交易中长期国债交易的交易所，当其 30 年期国债期货合约报价为 96-21 时，该合约价值为()。

- A、96556.25
- B、96656.25
- C、97556.25
- D、97656.25

答案：B

9、某投资者购买了某企业的 2 年期的债券，面值为 100000 美元，票面利率为 8%，按票面利率每半年付息一次，2 年后收回本利和。则此投资者的收益率为()。

- A、15%
- B、16%
- C、17%
- D、18%

答案：C

10、某大豆进口商在 5 月即将从美国进口大豆，为了防止价格上涨，2 月 10 日该进口商在 CBOT 买入 40 手敲定价格为 660 美分/蒲式耳，5 月大豆的看涨期权，权利金为 10 美分，当时 CBOT5 月大豆的期货价格为 640 美分。当期货价格涨到()时，该进口商的期权能达到盈亏平衡。

- A、640
- B、650
- C、670
- D、680

答案：C