**附件3**

**上 海 期 货 交 易 所**

**交易员、结算交割员考试样题**

**姓名 单位名称 得分**

**报考科目 交易员 结算交割员 （请在报考科目后打“√”）**

**说明：试卷共分三部分，第一部分基础知识共20分，为所有考生必答题；第二部分交易员业务知识共40分，为参加交易员考生必答题；第三部分结算交割员培训业务知识共40分，为参加结算员考生必答题；参加两门考试的考生，需完成三部分的作答。**

**请考生务必将答案填入答题卡中，在试题上作答均属无效。**

**第一部分 基础知识（20分）**

1. 单项选择题（每题0.5分，共10题）

例：目前，中国期货市场上最高行政法规是（ ）。

A．《期货交易管理条例》 B.《期货交易暂行管理条例》

C．《期货交易所管理办法》 D.《期货公司管理办法》

参考答案：A

1. 多项选择题（每题1分，共10题，多选或少选均不得分）

例：下列（ ）属于期货合约的主要条款。

A．合约名称 B.交割地点

C.最低交易保证金 D.交易时间

参考答案：ABCD

三、判断是非题（对的打√，错的打×，每题0.5分，共10题）

例：目前，我国期货市场“五位一体”的监管模式是指由中国证监会、证监会派出机构、中国期货保证金监控中心、各期货交易所、中国期货业协会构成的监管体系。

参考答案：√

**第二部分 交易员业务知识（40分）**

1. 单项选择题（每题0.5分，共20题）

例：为化解市场风险，交易所根据有关规定实施减仓时， （ ）进行减仓。

A、按先套期保值后投机的顺序

B、按先投机后套期保值的顺序

C、仅对套期保值

D、仅对投机

参考答案：B

1. 多项选择题（每题1分，共20题，多选或少选均不得分）

例：在某一期货合约的交易过程中，当出现下列（ ）情况时，交易所可以根据市场风险调整其涨跌停板幅度。

A、期货合约价格出现同方向连续涨跌停板

B、遇国家法定长假

C、交易所认为市场风险明显变化

D、交易所认为必要的其他情况

参考答案：ABCD

三、判断是非题（对的打√，错的打×，每题0.5分，共20题）

例：交易指令的报价只能在价格波动限制之内。

参考答案：√

**第三部分 结算交割员业务知识（40分）**

1. 单项选择题（每题0.5分，共20题）

例：为化解市场风险，交易所根据有关规定实施减仓时， （ ）进行减仓。

A、按先套期保值后投机的顺序

B、按先投机后套期保值的顺序

C、仅对套期保值

D、仅对投机

参考答案：B

1. 多项选择题（每题1分，共20题，多选或少选均不得分）

例：在某一期货合约的交易过程中，当出现下列（ ）情况时，交易所可以根据市场风险调整其涨跌停板幅度。

A、期货合约价格出现同方向连续涨跌停板

B、遇国家法定长假

C、交易所认为市场风险明显变化

D、交易所认为必要的其他情况

参考答案：ABCD

三、综合题（每题2分，共5题）

例：2008年10月24日，某期货公司买入50手al0910合约，结算价15500元/吨;卖出100手zn0811合约，结算价9800元/吨;当日结算后，结算准备金为230万元。

10月27日该会员入金50万元，买入开仓al0910合约20手，成交价15700元/吨，结算价15600元/吨；买入平仓zn0811合约10手，成交价9850元/吨，结算价9900元/吨；假设交易保证金均为5%。

铝：1手=5吨 锌：1手=5吨

1.10月24日，该会员的交易保证金为（ ）元。

A.438750 B.193750 C.24500 D.450000

参考答案：A

2. 10月27日，在al0910合约上的总盈亏是（ ）元。

A.-10000 B.25000 C.15000 D.30000

参考答案：C

3. 10月27日，在zn0811合约上的总盈亏是（ ）元。

A．-2500 B.-47500 C.-45000 D.-30000

参考答案：B

4.10月27日，该会员的交易保证金总共为（ ）元。

A．500000 B.495750 C.273000 D.222750

参考答案：B

5.10月27日，该会员的结算准备金为（ ）元。

A．2710500 B.2710000 C.300000 D.500000

参考答案：A

**上 海 期 货 交 易 所**

**交易员、结算交割员考试答题卡**

**姓名 单位名称 得分**

**报考科目 交易员 结算交割员 （请在报考科目后打“√”）**

**请在答题卡上作答，并将答案填写于题号后的方框内。**

**第一部分 基础知识（20分）**

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **1** |  | **11** |  | **21** |  |
| **2** |  | **12** |  | **22** |  |
| **3** |  | **13** |  | **23** |  |
| **4** |  | **14** |  | **24** |  |
| **5** |  | **15** |  | **25** |  |
| **6** |  | **16** |  | **26** |  |
| **7** |  | **17** |  | **27** |  |
| **8** |  | **18** |  | **28** |  |
| **9** |  | **19** |  | **29** |  |
| **10** |  | **20** |  | **30** |  |

**第二部分 交易员业务知识（40分）**

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **31** |  | **51** |  | **71** |  |
| **32** |  | **52** |  | **72** |  |
| **33** |  | **53** |  | **73** |  |
| **34** |  | **54** |  | **74** |  |
| **35** |  | **55** |  | **75** |  |
| **36** |  | **56** |  | **76** |  |
| **37** |  | **57** |  | **77** |  |
| **38** |  | **58** |  | **78** |  |
| **39** |  | **59** |  | **79** |  |
| **40** |  | **60** |  | **80** |  |
| **41** |  | **61** |  | **81** |  |
| **42** |  | **62** |  | **82** |  |
| **43** |  | **63** |  | **83** |  |
| **44** |  | **64** |  | **84** |  |
| **45** |  | **65** |  | **85** |  |
| **46** |  | **66** |  | **86** |  |
| **47** |  | **67** |  | **87** |  |
| **48** |  | **68** |  | **88** |  |
| **49** |  | **69** |  | **89** |  |
| **50** |  | **70** |  | **90** |  |

**第三部分 结算交割员业务知识（40分）**

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **91** |  | **111** |  | **131** |  |
| **92** |  | **112** |  | **132** |  |
| **93** |  | **113** |  | **133** |  |
| **94** |  | **114** |  | **134** |  |
| **95** |  | **115** |  | **135** |  |
| **96** |  | **116** |  |  |  |
| **97** |  | **117** |  |  |  |
| **98** |  | **118** |  |  |  |
| **99** |  | **119** |  |  |  |
| **100** |  | **120** |  |  |  |
| **101** |  | **121** |  |  |  |
| **102** |  | **122** |  |  |  |
| **103** |  | **123** |  |  |  |
| **104** |  | **124** |  |  |  |
| **105** |  | **125** |  |  |  |
| **106** |  | **126** |  |  |  |
| **107** |  | **127** |  |  |  |
| **108** |  | **128** |  |  |  |
| **109** |  | **129** |  |  |  |
| **110** |  | **130** |  |  |  |