

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）

一、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

二、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）

一、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

二、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）

一、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

二、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			