

2001 年期货从业人员资格考试应试指导

期货基础知识

期货市场的管理与法规

金德环 主编

上海财经大学出版社

2001 年期货从业人员资格考试应试指导

金德环 主编

责任编辑 王永长 麻俊生 封面设计 周卫民

上海财经大学出版社出版发行
(上海市中山北一路 369 号 邮编 200083)

网 址: <http://www.sufep.com>

电子邮件: webmaster@sufep.com

全国新华书店经销

上海市印刷七厂一分厂印刷装订

2001 年 3 月第 1 版 2001 年 4 月第 2 次印刷

ISBN 7-81049-568-2/F·481

850mm×1168mm 1/32 18 印张 451 千字

印数: 3 001—6 000 定价: 36.00 元

前 言

根据中国证监会的安排,期货从业人员资格考试将于今年六月下旬举行。为配合应试从业人员通过自学更有效地掌握考试内容,我们根据中国证监会期货监管部编写的《期货从业人员资格考试辅导》一书,编写了这本《2001年期货从业人员资格考试应试指导》。希望本书的面世能为期货从业人员通过资格考试起到事半功倍的积极效果。

本书在内容上分为两大部分,从第一章到第十一章为第一部分,内容为期货基础知识,对应于“期货基础知识”的考试。从第十二章到第十九章为第二部分,内容为期货市场的管理与法规,对应于“期货市场的管理与法规”的考试。在每一章的前面都附有内容提要和学习要点。本书设计的题型有六种:单项选择题、多项选择题、填空题、判断题、简答题和计算题(或案例题)。读者可以在复习过程中进行模拟练习。

本书内容已基本涵盖考试所要求的范围。只要应试人员认真复习,能对书中的每一个知识点融会贯通,则通过考试就是顺理成章的事了。

本书由上海财经大学证券期货学院的部分教师编写。其中第一章到第十一章由骆玉鼎负责编写,第十二章到第十九章由金德环负责编写。冯明德参与了第十三章到第十七章的编写。李鹏、

王俊、王薇、周维、徐健、毛豪列、潘锋、许春海、杜泽付、李胜利等参与了部分初稿的编写。

本书的编写时间紧迫，难免错误之处，欢迎读者批评指正，以利于日后进一步修订。

编者
2001年3月

目 录

期货基础知识

第一章 期货市场的产生和发展	(3)
一、本章大纲	(3)
二、内容提要	(4)
三、考核要点	(6)
四、复习题及参考答案	(6)
(一)单项选择题	(6)
(二)多项选择题	(12)
(三)填空题	(18)
(四)判断题	(23)
(五)简答题	(27)
第二章 期货市场的基本功能和作用	(36)
一、本章大纲	(36)
二、内容提要	(37)
三、考核要点	(39)
四、复习题及参考答案	(39)
(一)单项选择题	(39)

(二)多项选择题	(41)
(三)填空题	(43)
(四)判断题	(46)
(五)简答题	(48)
第三章 期货市场组织结构	(55)
一、本章大纲.....	(55)
二、内容提要.....	(56)
三、考核要点.....	(58)
四、复习题及参考答案.....	(58)
(一)单项选择题	(58)
(二)多项选择题	(62)
(三)填空题	(66)
(四)判断题	(70)
(五)简答题	(75)
第四章 商品期货	(86)
一、本章大纲.....	(86)
二、内容提要.....	(88)
三、考核要点.....	(91)
四、复习题及参考答案.....	(91)
(一)单项选择题	(91)
(二)多项选择题	(96)
(三)填空题.....	(111)
(四)判断题.....	(121)
(五)简答题.....	(125)

第五章 金融期货与期货期权	(136)
一、本章大纲	(136)
二、内容提要	(137)
三、考核要点	(139)
四、复习题及参考答案	(139)
(一)单项选择题.....	(139)
(二)多项选择题.....	(147)
(三)填空题.....	(155)
(四)判断题.....	(160)
(五)简答题.....	(165)
(六)计算题.....	(172)
第六章 期货交易基本制度	(175)
一、本章大纲	(175)
二、内容提要	(176)
三、考核要点	(178)
四、复习题及参考答案	(178)
(一)单项选择题.....	(178)
(二)多项选择题.....	(184)
(三)填空题.....	(190)
(四)判断题.....	(193)
(五)简答题.....	(197)
第七章 期货交易流程	(204)
一、本章大纲	(204)
二、内容提要	(205)
三、考核要点	(207)
四、复习题及参考答案	(207)

(一)单项选择题	(207)
(二)多项选择题	(212)
(三)填空题	(220)
(四)判断题	(224)
(五)简答题	(227)
(六)计算题	(232)
第八章 套期保值	(235)
一、本章大纲	(235)
二、内容提要	(236)
三、考核要点	(237)
四、复习题及参考答案	(237)
(一)单项选择题	(237)
(二)多项选择题	(243)
(三)填空题	(250)
(四)判断题	(254)
(五)简答题	(257)
(六)计算题	(266)
第九章 投机与套利	(272)
一、本章大纲	(272)
二、内容提要	(273)
三、考核要点	(276)
四、复习题及参考答案	(277)
(一)单项选择题	(277)
(二)多项选择题	(279)
(三)填空题	(286)
(四)判断题	(292)

(五)简答题	294
第十章 期货行情分析	309
一、本章大纲	309
二、内容提要	310
三、考核要点	312
四、复习题及参考答案	312
(一)单项选择题	312
(二)多项选择题	316
(三)填空题	318
(四)判断题	321
(五)简答题	323
(六)案例题	326
第十一章 期货市场的风险防范	331
一、本章大纲	331
二、内容提要	332
三、考核要点	333
四、复习题及参考答案	334
(一)单项选择题	334
(二)多项选择题	336
(三)填空题	340
(四)判断题	344
(五)简答题	346
(六)案例题	353

期货市场的管理与法规

第十二章 期货市场的管理与法规	(361)
一、内容提要	(361)
二、复习题及参考答案	(362)
(一)单项选择题.....	(362)
(二)多项选择题.....	(365)
(三)填空题.....	(368)
(四)判断题.....	(370)
(五)简答题.....	(372)
第十三章 《期货交易管理暂行条例》	(376)
一、内容提要	(376)
二、复习题及参考答案	(379)
(一)单项选择题.....	(379)
(二)多项选择题.....	(388)
(三)填空题.....	(404)
(四)判断题.....	(415)
(五)简答题.....	(426)
第十四章 《期货交易所管理办法》	(432)
一、内容提要	(432)
二、复习题及参考答案	(435)
(一)单项选择题.....	(435)
(二)多项选择题.....	(440)

(三) 填空题	(451)
(四) 判断题	(459)
(五) 简答题	(468)
第十五章 《期货业从业人员资格管理办法》	(479)
一、内容提要	(479)
二、复习题及参考答案	(480)
(一) 单项选择题	(480)
(二) 多项选择题	(483)
(三) 填空题	(486)
(四) 判断题	(490)
(五) 简答题	(492)
第十六章 《期货经纪公司管理办法》	(496)
一、内容提要	(496)
二、复习题及参考答案	(497)
(一) 单项选择题	(497)
(二) 多项选择题	(500)
(三) 填空题	(503)
(四) 判断题	(505)
(五) 简答题	(507)
第十七章 《期货经纪公司高级管理人员任职资格管理办法》	(511)
一、内容提要	(511)
二、复习题及参考答案	(512)
(一) 单项选择题	(512)
(二) 多项选择题	(515)

(三)填空题	(519)
(四)判断题	(522)
(五)简答题	(526)

第十八章 《关于加强期货经纪公司内部控制的指导原则》

.....	(530)
一、内容提要	(530)
二、复习题及参考答案	(532)
(一)单项选择题	(532)
(二)多项选择题	(535)
(三)填空题	(539)
(四)判断题	(543)
(五)简答题	(547)

第十九章 《期货交易所、期货经营机构信息技术管理规范(试行)》

.....	(555)
一、内容提要	(555)
二、复习题及参考答案	(556)
(一)单项选择题	(556)
(二)多项选择题	(556)
(三)填空题	(558)
(四)判断题	(560)
(五)简答题	(561)

期货基础知识

第一章 期货市场的产生和发展

一、本章大纲

第一节 期货市场的产生

一、期货交易的起源

二、期货交易与现货交易

1. 期货交易与现货交易的联系
2. 期货交易与现货交易的区别

三、期货交易与远期交易

1. 期货交易与远期交易的联系
2. 期货交易与远期交易的区别

四、期货交易的基本特征

1. 合约标准化
2. 交易集中化
3. 双向交易和对冲机制
4. 每日无负债结算制度
5. 杠杆机制

五、期货市场与证券市场

1. 基本经济职能不同
2. 交易目的不同
3. 市场结构不同

4. 保证金规定不同

第二节 期货市场的发展

一、期货市场的发展过程

1. 商品期货

2. 金融期货

3. 期货期权

二、国际期货市场的发展趋势

1. 期货中心日益集中

2. 联网合并发展迅速

3. 金融期货后来居上

4. 交易方式不断创新

5. 服务质量不断提高

第三节 我国期货市场的建立与规范

一、我国期货市场的建立

1. 我国期货市场产生的背景

2. 我国期货市场的初创

二、我国期货市场的治理整顿

1. 监管架构的确立

2. 期货交易所的清理整顿

3. 期货经纪公司的清理整顿

4. 违规事件的处理

三、我国期货市场的现状

1. 主要成就

2. 我国期货市场在初建时存在的主要问题

二、内容提要

本章主要介绍了期货市场的产生和发展及我国期货市场的建