

# 附件 1

## 2023 年“期货基础知识”考试大纲

### 第一章 期货及衍生品概述

第一节 衍生品市场的产生与发展

第二节 基础衍生工具

第三节 衍生品的交易特征与市场类型

第四节 衍生品市场的功能与作用

### 第二章 期货市场组织结构

第一节 期货交易所

第二节 期货结算机构

第三节 期货公司与服务机构

第四节 期货交易者

### 第三章 期货合约与期货交易制度

第一节 期货合约

第二节 期货市场基本制度

第三节 期货交易流程

### 第四章 套期保值

第一节 套期保值的概念与原理

第二节 套期保值的种类

第三节 基差与套期保值效果

第四节 套期保值的业务拓展

## **第五章 投机与套利**

第一节 期货投机交易

第二节 期货套利交易

第三节 期货套利的基本策略

第四节 期货价差套利指令

## **第六章 利率期货**

第一节 利率期货及其价格影响因素

第二节 国债期货及其应用

## **第七章 外汇期货**

第一节 外汇与汇率

第二节 外汇期货及其应用

## **第八章 股指期货**

第一节 股票与股票价格指数

第二节 个股期货与股指期货

第三节 股指期货套期保值交易

#### 第四节 股指期货投机与套利交易

### 第九章 期权

#### 第一节 期权及期权交易

#### 第二节 期权价格及影响因素

#### 第三节 期权交易策略

#### 第四节 奇异期权

### 第十章 远期合约

#### 第一节 远期合约概述

#### 第二节 商品远期

#### 第三节 远期利率协议

#### 第四章 外汇远期与外汇掉期

### 第十一章 互换

#### 第一节 互换概述

#### 第二节 利率互换

#### 第三节 货币互换

### 第十二章 期货及衍生品价格分析

#### 第一节 期货与期权行情解读

#### 第二节 基本面分析

#### 第三节 技术分析

## **第十三章 期货市场监管与风险控制**

### **第一节 期货市场风险及其成因**

### **第二节 中国期货市场监管体系**

### **第三节 期货市场风险控制**