

股指期货基础知识测试试题 (B卷)

(共30道题, 答对24题为合格。测试时间为30分钟。)

客户姓名: _____ 答题日期: _____

客户身份证号码: _____ 答对题数: _____

一、判断题(本大题共10道小题, 对的打“√”, 错的打“X”, 请将正确答案填入下面的表格中)

| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 | 8 | 9 | 10 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|----|
| | | | | | | | | | |

1. 沪深300股指期货交易实行大户持仓报告制度, 客户持仓达到交易所规定的报告标准的, 应及时向交易所报告。()
2. 期货交易必须在依法设立的期货交易所或者国务院期货监管机构批准的其他交易场所进行。()
3. 投资者可以使用已开立的证券账户进行股指期货交易。()
4. 沪深300指数的编制采用自由流通股本而非总股本加权, 样本股权重分布较为均衡, 具有较强的抗操纵性。()
5. 沪深300股指期货合约的交易保证金标准是固定的。()
6. 投资者应当如实申报开户材料, 不得采取虚假申报等手段规避投资者适当性制度要求。()
7. 股指期货合约的当日结算价是计算当日持仓盈亏的依据, 沪深300股指期货合约以该合约当天收盘价作为当日结算价。()
8. 沪深300股指期货合约的合约月份为当月、下月及随后两个季月, 季月是指3月、6月、9月、12月。()

9. 客户在不同的会员处开户的,其交易编码中客户号应当相同。()

10. 沪深 300 股指期货市价指令未成交的部分自动撤销。()

二、单项选择题(本大题共 20 道小题,每题仅有一个正确答案,请将正确答案填入下面的表格中)

| | | | | | | | | | |
|----|----|----|----|----|----|----|----|----|----|
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 | 8 | 9 | 10 |
| | | | | | | | | | |
| 11 | 12 | 13 | 14 | 15 | 16 | 17 | 18 | 19 | 20 |
| | | | | | | | | | |

1. 通过集合竞价买卖沪深 300 股指期货合约,交易指令的申报时间为()。

A、9: 14-9: 15 B、9: 10-9: 14 C、9: 00-9: 10

2. 投资者以限价指令的方式卖出开仓沪深 300 股指期货某合约,申报价格为 3000 点,其成交价不可能为()点。

A、3001 B、3000 C、2999

3. 假设某投资者当日只进行了两笔交易:以 3600 点卖出开仓 2 手沪深 300 股指期货某合约,以 3640 点买入平仓 1 手该合约,当日该合约收盘价为 3660 点,结算价为 3650 点,如果该投资者没有其他持仓且不考虑手续费,当日结算后其账户的亏损为()。

A、30000 元 B、27000 元 C、3000 元

10. 沪深 300 股指期货某合约当天集合竞价未产生成交价格,则该合约的开盘价为该合约 ()。
- A、集合竞价后第一笔成交价
 - B、上一交易日收盘价
 - C、上一交易日结算价
11. 股指期货交易的对象是 ()。
- A、标的指数股票组合
 - B、股指期货合约
 - C、标的指数 ETF 份额
12. 沪深 300 股指期货某合约的价格为 3050 点,当时沪深 300 指数为 3000 点,则一手该合约的价值为 () 万元。
- A、91.5 B、90 C、61 D、60
13. 投资者进行股指期货交易,发生保证金不足,且未在期货公司规定的时间内及时追加保证金或自行平仓,期货公司有权对其持仓进行 ()。
- A、强制减仓 B、强行平仓 C、协议平仓
14. 只有取得中间介绍业务资格的 () 方可接受相应的期货公司委托,为该期货公司介绍客户参与股指期货交易。
- A、基金管理公司
 - B、咨询服务公司
 - C、证券公司

15. 沪深 300 股指期货某合约上一交易日结算价为 4000 点, 收盘价为 4100 点, 当日(非最后交易日)该合约的跌停板价格为()。
- A、3200 点 B、3600 点 C、3690 点
16. 适用于买入套期保值的情况是()。
- A、手中持有股票组合, 担心股市下跌导致损失
B、未来准备买入股票, 担心股市上涨增加成本
C、手中持有股票组合, 并看涨后市
17. 期货公司应当在()向投资者揭示期货交易风险。
- A、投资者开户前 B、投资者开户后 C、交易亏损时
18. 股指期货合约的价格与其标的指数走势密切相关, 沪深 300 股指期货合约的合约标的是()。
- A、上证综合指数 B、沪深 300 指数 C、深证成份指数
19. 投资者带现金到期货公司办理入金手续, 但遭拒绝, 是因为()。
- A、期货公司只接受支票入金
B、投资者入金必须通过其期货结算账户和期货公司保证金账户间以同行转账的形式办理
20. 沪深 300 股指期货合约到期时, 采用()。
- A、现金交割
B、沪深 300 成份股股票交割
C、沪深 300ETF 交割

客户承诺书

本人在此郑重承诺，以上题目均为本人回答。如答卷分数未达到标准或者由他人代答，本人自愿撤销本次开户申请。

承诺人（签字）：

期货公司开户知识测试人员（签字）：