

股指期货基础知识测试试题 (A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. 期货公司为客户开立账户, 应当对客户开户资料进行审核, 确保开户资料的合规、真实、准确和完整。()
2. IF1007 合约表示的是2010年7月到期的沪深300股指期货合约。()
3. 客户申请沪深300股指期货某合约套期保值额度的, 应当向其开户的会员申报, 会员对申报材料进行审核后向交易所办理申请手续。()
4. 沪深300股指期货市价指令未成交部分自动转为限价指令。()
5. 沪深300指数可综合反映沪深A股市场整体表现, 其成份股由沪深两市A股中规模大、流动性好的300只股票组成。()
6. 期货公司客户开发人员不得兼任开户知识测试人员。()
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. 中金所实行交易编码制度, 会员应当为每一个客户单独开立专门

账户、申请交易编码，不得混码交易。()

9. 沪深 300 股指期货合约的交易保证金标准是固定的。()
10. 期货公司应当在期货经纪合同中与客户约定风险管理的标准、条件及处置措施。()

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. 某投资者卖出开仓沪深 300 股指期货某合约 10 手，再买入开仓该合约 4 手后，该投资者对该合约的持仓为()。
- A、4 手多单 B、6 手空单 C、10 手空单、4 手多单
2. 甲投资者买入平仓 10 手沪深 300 股指期货某合约，乙投资者卖出开仓 10 手，甲乙恰好相互成交后，市场上该合约的总持仓量将()。
- A、增加 10 手 B、增加 20 手
- C、减少 10 手 D、没有变化
3. 沪深 300 股指期货合约以()作为合约的标的。
- A、上证 50 指数
- B、深证 100 指数
- C、沪深 300 指数

4. 证券公司受期货公司委托从事中间介绍业务, 不得提供下列何种服务 ()。
- A、协助办理开户手续
B、提供期货行情信息、交易设施
C、利用证券资金账户为客户存取、划转期货保证金
5. 沪深 300 股指期货合约的交割结算价为最后交易日 ()。
- A、沪深 300 指数的收盘价
B、沪深 300 指数最后 2 小时的算术平均价
C、到期合约的收盘价
6. 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
7. 某交易日收盘后, 某投资者持有 1 手沪深 300 股指期货某合约空单, 该合约收盘价为 3560 点, 结算价为 3550 点。下一交易日该投资者未进行任何操作, 该合约的收盘价为 3600 点, 结算价为 3610 点, 结算后该笔持仓的当日亏损为 ()。
- A、18000 元 B、15000 元 C、12000 元
8. 沪深 300 股指期货合约非最后交易日的交易时间为 ()。
- A、9: 15-11: 30 (第一节), 13: 00-15: 00 (第二节)
B、9: 30-11: 30 (第一节), 13: 00-15: 00 (第二节)
C、9: 15-11: 30 (第一节), 13: 00-15: 15 (第二节)

9. 沪深 300 股指期货在 () 挂牌交易。
- A、中国金融期货交易所 B、上海证券交易所
C、深圳证券交易所 D、上海期货交易所
10. 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
11. 客户在股指期货交易中发生保证金不足,且未能按照经纪合同中的约定及时追加保证金或者主动减仓,该客户部分或全部持仓将被 ()。
- A、强制减仓 B、强行平仓 C、协议平仓
12. 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
13. 沪深 300 股指期货某合约报价为 3000 点,则 1 手按此报价成交的合约价值为 ()。
- A、60 万元 B、90 万元 C、120 万元

14. 下列何种情形不属于交易所规定的异常交易行为 ()。
- A、委托、授权给同一机构或者同一个人代为从事交易的客户之间，大量或者多次进行互为对手方交易
 - B、进行期现套利交易
 - C、日内撤单次数过多
 - D、日内频繁进行回转交易或者日内开仓交易量较大
15. 沪深 300 股指期货合约的最小变动价位为 () 指数点，该合约交易报价指数点必须为最小变动价位的整数倍。
- A、0.05 点
 - B、0.1 点
 - C、0.2 点
16. 某投资者欲在 3 个月后买入价值 1000 万元的股票组合，担心股市上涨增加投资成本，可采用的策略是 ()。
- A、买入股指期货进行套期保值
 - B、卖出股指期货进行套期保值
 - C、期现套利
17. 以下关于沪深 300 股指期货限价指令，说法错误的是 ()。
- A、限价指令按照限定价格或者更优价格成交
 - B、限价指令每次最大下单数量为 100 手
 - C、集合竞价指令申报时间不接受限价指令
18. 建立多头持仓应该下达 () 指令。
- A、买入开仓
 - B、买入平仓
 - C、卖出开仓
 - D、卖出平仓

19. 最后交易日, 沪深 300 股指期货当月合约的涨跌停板幅度为()。
- A、上一交易日结算价的 $\pm 20\%$ 。
 - B、上一交易日结算价的 $\pm 10\%$ 。
 - C、当日开盘价的 $\pm 10\%$
20. 沪深 300 股指期货合约的最后交易日为合约到期月份的(), 遇国家法定假日顺延。
- A、第一个交易日
 - B、第三个周五
 - C、最后一个交易日

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):