

## 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. 中金所交易编码由十二位数字构成, 前四位为会员号, 后八位为客户号。( )
2. 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。( )
3. 沪深 300 股指期货合约的最小变动价位为 0.01 点。( )
4. 投资者用于期货交易的出入金应当通过投资者期货结算账户和期货经纪公司保证金账户以同行转账的形式办理。( )
5. 证券公司可以为自己的客户从事期货交易提供融资服务。( )
6. 自然人投资者应当本人亲自办理开户手续, 签署开户资料, 不得委托代理人代为办理开户手续。( )
7. 沪深 300 股指期货合约的交割结算价为最后交易日该合约全天成交价按成交量的加权平均价。( )
8. 股指期货合约价值为股指期货指数点乘以合约乘数。( )
9. 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。( )

10. 股指期货采用保证金交易制度, 风险较大, 投资者应有止损意识。  
( )

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. 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
2. 沪深 300 股指期货合约的交割日为 ( ), 遇国家法定假日顺延。
- A、合约到期月份的 15 日  
B、合约到期月份的第三个周五  
C、合约到期月份的最后一个交易日
3. 客户出现交易所规定的异常交易行为并经劝阻、制止无效的, 会员可以采取的措施不包括 ( )。
- A、提高交易保证金  
B、限制开仓  
C、强制减仓  
D、拒绝客户委托或终止经纪关系

4. 多头持仓是指( )后持有的未平仓头寸。
- A、买入开仓    B、卖出开仓  
C、买入平仓    D、卖出平仓
5. 沪深300股指期货投资者可以通过( )建立的投资者查询服务系统查询其有关期货交易结算信息。
- A、中国期货保证金监控中心  
B、中国期货业协会  
C、中国金融期货交易所
6. 如果某投资者认为沪深300股指期货某合约的价格会下跌,应( )该合约。
- A、买入开仓    B、卖出开仓
7. 某投资者欲在3个月后卖出目前所持有的价值1000万元的股票组合,担心股市下跌而遭受损失,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
8. 沪深300股指期货合约的当日结算价为该期货合约的( )。
- A、全天成交价格按照成交量的加权平均价  
B、收盘价  
C、最后一小时成交价格按照成交量的加权平均价

9. 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
10. 沪深 300 股指期货交易中, 单边市是指某一合约收市前 ( ) 分钟内出现只有停板价格的买入 ( 卖出 ) 申报、没有停板价格的卖出 ( 买入 ) 申报, 或者一有卖出 ( 买入 ) 申报就成交、但未打开停板价格的情形。
- A、1                                      B、5                                      C、10
11. 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
12. 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
13. 沪深 300 股指期货投资者不得采用 ( ) 下达交易指令。
- A、书面委托                              B、电话委托  
C、互联网委托                              D、全权委托期货公司

14. 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)
15. 2010 年 6 月 3 日 (周四), 中国金融期货交易所可供交易的沪深 300 股指期货合约应该有 ( )。
- A、IF1006 合约、IF1007 合约、IF1008 合约、IF1009 合约  
B、IF1006 合约、IF1007 合约、IF1009 合约、IF1012 合约  
C、IF1006 合约、IF1009 合约、IF1012 合约、IF1103 合约
16. 如果 IF1007 合约的挂盘基准价为 4000 点, 在该合约的上市首日, 其涨停板价格为 ( )。
- A、4800 点                      B、4600 点                      C、4400 点
17. 期货公司收取投资者的保证金, 一般会在交易所要求的保证金基础上 ( )。
- A、上浮一定比率                      B、下浮一定比率
18. 以下关于沪深 300 股指期货市价指令, 说法正确的是 ( )。
- A、市价指令的成交价格可以超出涨跌停板价格范围  
B、市价指令只能和限价指令撮合成交  
C、集合竞价指令申报时间接受市价指令

19. 甲投资者买入开仓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
20. 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

---

### 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):