

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 股指期货合约报价的最小变动价位是 0.2 点, 某投资者以 3660.5 点的限价指令申报为无效申报。()
2. 沪深 300 股指期货合约的合约乘数为每点人民币 100 元。()
3. 证券公司受期货公司委托从事中间介绍业务, 可以利用客户的证券资金账户为其存取、划转期货保证金。()
4. 股指期货合约到期时必须交割股票。()
5. 投资者可以使用已开立的证券账户进行股指期货交易。()
6. 投资者用于期货交易的出入金应当通过开设在同一期货结算银行的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, 不得通过现金收付或期货经纪公司内部划转的方式办理出入金。()
7. 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。()

8. 客户参与股指期货交易在不同的会员处开户的,其交易编码中客户号应当相同。()
9. 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。()
10. 期货公司客户开发人员不得兼任开户知识测试人员。()

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. 某投资者以3600点买入开仓1手沪深300股指期货某合约后,以3540点卖出平仓1手该合约,当日该合约收盘价为3560点,结算价为3550点,如果不考虑手续费,该笔交易的亏损为()。
- A、18000元 B、15000元 C、12000元
2. 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

3. 甲投资者买入平仓 10 手沪深 300 股指期货某合约, 乙投资者卖出平仓 10 手, 甲乙恰好相互成交后, 市场上该合约的总持仓量将()。
- A、减少 10 手 B、减少 20 手
C、增加 10 手 D、没有变化
4. 某投资者持有价值 1000 万元的某限售股票, 担心解禁后股市下跌导致资产缩水, 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
5. 沪深 300 股指期货合约的合约标的是 ()。
- A、上证综合指数 B、深证成份指数 C、沪深 300 指数
6. 某投资者买入开仓沪深 300 股指期货某合约 10 手, 于次日卖出平仓该合约 4 手, 该投资者对该合约的持仓手数为 ()。
- A、4 手 B、6 手 C、14 手
7. 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
8. 沪深 300 股指期货投资者下达交易指令可以采用 ()。
- A、书面委托 B、电话委托
C、互联网委托 D、以上均包括

9. 如果沪深 300 股指期货某合约上一交易日结算价为 3000 点, 上一交易日收盘价为 3100 点, 若当日该合约的涨跌停板幅度为 $\pm 10\%$, 则以下申报指令无效的是 ()。
- A、以 2700 点限价买入开仓 1 手该合约
 - B、以 3000 点限价买入开仓 1 手该合约
 - C、以 3400 点限价买入开仓 1 手该合约
10. 以下关于沪深 300 股指期货市价指令, 说法错误的是 ()。
- A、市价指令只能和限价指令撮合成交
 - B、市价指令的成交价格为涨跌停板价格
 - C、集合竞价指令申报时间不接受市价指令
11. 卖出开仓股指期货合约后的持仓叫 ()。
- A、多头持仓
 - B、空头持仓
 - C、总持仓
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 股指期货的 4 个合约月份分别为 ()。
- A、当月、下月及随后两个季月
 - B、3 月、6 月、9 月及 12 月
 - C、连续 4 个月

14. 下列何种情形不属于交易所规定的异常交易行为()。
- A、以自己为交易对象,大量或者多次进行自买自卖
 - B、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
 - C、同一客户在多家会员开户
 - D、日内撤单次数过多
15. 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
16. 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
17. 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、第三个周五
 - B、第三个周四
 - C、第三个周三
18. 投资者以限价指令的方式买入开仓沪深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
19. 沪深300股指期货交易实行持仓限额制度,进行投机交易的客户号某一合约单边持仓限额为()。
- A、100手
 - B、200手
 - C、300手

20. 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

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):