

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 股指期货合约以该合约当天收盘价作为当日结算价。()
3. 沪深 300 股指期货有 4 个合约同时挂牌交易, 投资者交易时必须同时买卖 4 个合约。()
4. 沪深 300 股指期货市价指令未成交的部分自动撤销。()
5. 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 300 手。()
6. 投资者可以使用已开立的证券账户进行股指期货交易。()
7. 沪深 300 股指期货合约的交易保证金标准是固定的。()
8. 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。()

9. 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。()
10. 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。()

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. 只有取得中间介绍业务资格的 () 方可接受相应期货公司的委托,为该期货公司介绍客户参与股指期货交易。
- A、证券公司 B、基金管理公司 C、商业银行
2. 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
3. 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)

4. 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
5. 股指期货合约的标准化是指除 () 外的所有要素都是统一规定的。
- A、价格 B、合约乘数 C、报价单位
6. 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
7. 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
8. 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
9. 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

10. 买入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
11. 某投资者买入开仓沪深 300 股指期货某合约 10 手后, 误将 4 手卖出平仓单下成卖出开仓, 全部成交后, 该投资者对该合约的持仓为 ()。
- A、4 手空单
- B、6 手多单
- C、4 手空单、10 手多单
12. 股指期货交易具有杠杆性, 既放大盈利也放大亏损, 是因为实行了 ()。
- A、双向交易制度
- B、保证金制度
- C、当日无负债结算制度
13. 沪深 300 股指期货季月合约上市首日的涨跌停板幅度为该合约挂盘基准价的 ()。
- A、 $\pm 6\%$ B、 $\pm 10\%$ C、 $\pm 20\%$
14. 适用于卖出套期保值的情形是 ()。
- A、手中持有股票组合, 担心股市下跌
- B、未来准备买入股票, 担心股市上涨
- C、手中持有股票组合, 并看涨后市

15. 某交易日, 如果 IF1005 合约的涨跌停板价格分别为 3300 点和 2700 点, 则以下申报指令无效的是 ()。
- A、以 2700.0 点限价指令买入开仓 1 手 IF1005 合约
B、以 3000.2 点限价指令买入开仓 1 手 IF1005 合约
C、以 3000.5 点限价指令卖出开仓 1 手 IF1005 合约
D、以 3300.0 点限价指令卖出开仓 1 手 IF1005 合约
16. 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
17. 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
18. 假设某投资者当日只进行了两笔交易: 以 3600 点买入开仓 2 手沪深 300 股指期货某合约后, 以 3540 点卖出平仓 1 手该合约, 如果当日该合约收盘价为 3560 点, 结算价为 3550 点, 而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、33000 元 B、30000 元 C、3000 元

19. 会员应当与客户约定, 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, 会员可以采取以下何种措施 ()。
- A、提高交易保证金 B、限制开仓
- C、拒绝客户委托或终止经纪关系 D、以上均包括
20. 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

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):