

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. 沪深300股指期货投资者可以通过中国期货保证金监控中心网站查询自己的期货结算账单。()
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。()
4. 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。()
5. 沪深300股指期货合约的交易保证金标准是固定的。()
6. 沪深300股指期货市价指令未成交的部分自动撤销。()
7. 期货公司客户开发人员不得兼任开户知识测试人员。()
8. 交易所通过情况报告和谈话,发现会员或者客户有违规嫌疑、交易头寸有较大风险的,有权对会员或者客户发出《风险警示函》。()

9. 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。()
10. 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。()

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. 某投资者持有 2 手沪深 300 股指期货某合约多头持仓, 可通过()该合约了结该持仓。
- A、买入开仓 2 手 B、买入平仓 2 手
- C、卖出开仓 2 手 D、卖出平仓 2 手

4. 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
5. 沪深 300 股指期货的交割方式为 ()。
- A、现金交割
 - B、ETF 基金份额交割
 - C、股票交割
6. 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
7. 空头持仓是指 () 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
8. 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
9. 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

10. 某投资者以 3000 点卖出开仓 1 手沪深 300 股指期货某合约, 如果当日该合约的收盘价为 3080 点, 结算价为 3100 点, 如果不考虑手续费, 结算后该笔持仓的浮动亏损为 ()。
- A、30000 元 B、24000 元 C、15000 元
11. 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
12. 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
13. 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
14. 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

15. 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
16. 沪深 300 股指期货某合约的价格为 4000 点,当时沪深 300 指数为 4050 点,则一手该合约的价值为()万元。
- A、121.5 B、120 C、81 D、80
17. 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
18. 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
19. 沪深 300 股指期货合约在其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)
20. 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

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):