

2009年证券投资分析每日一练（12月31日）证券从业资格考试 PDF转换可能丢失图片或格式，建议阅读原文

[https://www.100test.com/kao\\_ti2020/645/2021\\_2022\\_2009\\_E5\\_B9\\_B4\\_E8\\_AF\\_81\\_c33\\_645313.htm](https://www.100test.com/kao_ti2020/645/2021_2022_2009_E5_B9_B4_E8_AF_81_c33_645313.htm)

单选题某私募基金想运用4个月期的沪深300股指期货合约来对冲某个价值为10.5亿元的股票组合，该组合的β系数为1.2，当时的股指期货价格为2800点，则应在股指期货市场建立股指期货的头寸为（ ）。 A．卖出1500张期货合约 B．买入1500张期货合约 C．卖出150张期货合约 D．买入150张期货合约 【正确答案】：A 【参考解析】：一份沪深300股指期货合约的价值是 $2800 \times 300 = 840000$ ，因而应该卖出的指数期货合约数目是： $N = 1050000000 \div 840000 \times 1.2 = 1500$ 。所以正确答案是A。更多试题请点击：百考试题在线题库 100Test 下载频道开通，各类考试题目直接下载。详细请访问 [www.100test.com](http://www.100test.com)