

105 年第 2 次期貨交易分析人員資格測驗試題

專業科目：期貨法規與自律規範

請填入場證編號：_____

※ 注意：(1)選擇題請在「答案卡」上作答，每一試題有(A)(B)(C)(D)選項，本測驗為單一選擇題，請依題意選出一個正確或最適當的答案。

(2)申論題請在「答案卷」上依序標明題號作答，不必抄題。

一、選擇題(共 35 題，每題 2 分，共 70 分)

- 依我國期貨交易法對於期貨選擇權契約定義之敘述，下列何者正確？
 - 當事人約定於未來特定期間，依特定價格及數量等交易條件買賣約定標的物，或於到期前或到期時結算差價之契約
 - 當事人約定，選擇權買方支付權利金，取得購入或售出之權利，得於特定期間內，依特定價格及數量等交易條件買賣約定標的物
 - 當事人約定，選擇權買方支付權利金，取得購入或售出之權利，得於特定期間內，依特定價格及數量等交易條件買賣期貨契約；選擇權賣方，於買方要求履約時，有依選擇權約定履行義務；或雙方同意於到期前或到期時結算差價之契約
 - 當事人約定一方支付一定成數之款項，雙方於未來特定期間內，依約定方式結算差價
- 依我國期貨交易法之規定，下列何種交易不適用期貨交易法？ 1.外匯經紀商經核准在其營業處所經營之換匯交易；2.金融機構經核准在營業處所經營之換匯換利交易；3.金融機構經核准在營業處所經營之貨幣選擇權；4.金融機構經核准在營業處所經營之利率選擇權
 - 僅 1、3
 - 僅 1、2
 - 僅 1、2、3
 - 1、2、3、4 皆不適用
- 公司制期貨交易所之董事、監察人由非股東之相關專家擔任者，其人數及擔任之程序，下列敘述何者正確？
 - 三分之一由主管機關指派，其餘由期貨交易所遴選擔任之
 - 三分之一由主管機關指派，其餘由期貨交易所遴選，報主管機關核定後擔任之
 - 半數由主管機關指派，其餘由期貨交易所股東會選舉產生之，並報主管機關備查
 - 半數由主管機關指派，其餘由期貨交易所董事會遴選，報主管機關核定後擔任之
- 依期貨交易所管理規則之規定，期貨交易所所有下列何情事時，除應即為適當處置外，並應於事實發生之次日前向主管機關申報？ 1.因不可抗拒之偶發事故臨時停止當市之集會；2.交易系統發生故障；3.期貨商逾時繳交保證金；4.期貨商無法繳交保證金
 - 1、2、3、4 皆是
 - 僅 1、2、4
 - 僅 1、2、3
 - 僅 2、3、4
- 會員或期貨商不能履行結算交割義務時，期貨交易所應採取下列何種措施？ 1.督導承受之會員或期貨商接辦相關事務；2.立刻通知該會員或期貨商追加交割結算基金；3.會同期貨結算機構進行專案檢查；4.金管會進行專案檢查
 - 僅 1、3
 - 僅 2、3
 - 僅 2、3、4
 - 僅 1、3、4
- 依我國期貨交易法，期貨結算機構對其結算會員不履行結算交割義務時，得以事先繳存之款項支應，支應之順序為何？ 1.期貨結算機構之賠償準備金；2.違約期貨結算會員之交割結算基金；3.違約期貨結算會員繳存之結算保證金；4.其他期貨結算會員之交割結算基金；5.其他期貨結算會員依期貨結算機構所定之比例分擔
 - 1、2、3、4、5
 - 2、3、1、4、5
 - 3、2、4、1、5
 - 2、3、4、1、5
- 依我國期貨交易法，關於期貨結算機構收取結算保證金之規定，下列何者正確？ 1.得以現金繳交；2.得以經核定之有價證券繳交；3.有價證券抵繳結算保證金之比例，由期貨結算機構定之；4.結算保證金之收取方式，由期貨結算機構訂定，報請主管機關核定
 - 僅 2、3、4
 - 僅 1、2、4
 - 僅 1、4
 - 僅 1、2、3
- 對於結算會員之結算、交割行為違背誠實信用，以致他人受損害者，期貨結算機構得採取下列何種處分？ 1.限制其交易數量；2.課以違約金；3.停止或限制其於期貨結算機構所為之結算、交割；4.命令該結算會員追加交割結算基金
 - 僅 1、4
 - 僅 3、4
 - 僅 2、3
 - 僅 1、3
- 經評估發現，客戶之信用狀況與財力不足以從事期貨交易時，期貨商得採取下列何種措施？ 1.拒絕其委託；2.接受其委託但限制其交易數量；3.接受其委託但提高保證金；4.要求其提出適當擔保後得接受其委託
 - 僅 1、3
 - 僅 3、4
 - 僅 1、4
 - 僅 1、2
- 期貨商之業主權益低於最低實收資本額一定成數時，主管機關得採取下列何種措施？ 1.追加營業保證金；2.限期令其改善；3.限制其部分業務；4.撤銷其許可
 - 僅 1、3、4
 - 僅 2、3、4
 - 僅 1、2、4
 - 僅 1、4

11. 關於本國期貨商申請設置分支機構之規定，下列何者正確？ 1.期貨商得於申請設置許可時，同時申請設置分支機構；2.每設置一家分支機構，其最低實收資本額應增加新臺幣一千萬元；3.期貨商於開始營業後，雖最近一年曾受停業處分，但情事已具體改善並經金管會認可，仍得申請設置分支機構；4.期貨商分支機構業務員不得少於三人
- (A)僅 1、3、4 (B)僅 2、3、4 (C)僅 1、2、4 (D)僅 3、4
12. 有關本國證券商申請兼營期貨經紀業務並指撥專用營運資金之規定，下列敘述何者正確？
- (A)申請兼營國內期貨及選擇權契約經紀業務者，應指撥專用營運資金新臺幣二億元
(B)申請兼營國內股價類期貨及選擇權契約經紀業務及國內利率類期貨契約經紀業務者，應指撥專用營運資金新臺幣一億元
(C)申請兼營國內股價類期貨及選擇權契約經紀業務者，應指撥專用營運資金新臺幣五千萬元
(D)申請兼營國內利率類期貨及選擇權契約經紀業務者，應指撥專用營運資金新臺幣八千萬元
13. 本國期貨商之業主權益低於最低實收資本額多少比例時，應即向主管機關及主管機關指定之機構申報？
- (A)百分之六十 (B)百分之四十 (C)百分之二十 (D)百分之十五
14. 有關期貨商製作與交付買賣報告書之規定，下列敘述何者錯誤？
- (A)期貨商受託從事期貨交易，應於成交後製作買賣報告書交付期貨交易人確認
(B)期貨商受託從事期貨交易，於客戶成交後，如已辦理交易確認並留存紀錄，毋須再請客戶於買賣報告書上簽名或蓋章
(C)期貨交易人委託代理人代理買賣，期貨商應按月製作買賣報告書交付期貨交易人確認
(D)期貨交易人委託代理人代理買賣，而由代理人確認買賣報告書者，須檢附期貨交易人本人之委託書
15. 證券商兼營期貨業務，其業務員如具有證券及期貨業務員資格者，於下列何者得同時辦理證券及期貨相同性質之業務？ 1.受託買賣；2.內部稽核；3.風險管理；4.法令遵循；5.主辦會計
- (A)僅 1、2、3、4 (B)僅 1、3、4、5 (C)僅 1、2、4、5 (D)1、2、3、4、5 皆是
16. 依我國期貨交易法之規定，期貨商自客戶保證金專戶中提取款項作為另一期貨交易人進行期貨交易所應支付之期貨交易保證金或權利金，其法定刑可處多少？
- (A)七年以下有期徒刑得併科新臺幣三百萬元以下罰金
(B)五年以下有期徒刑、拘役或科或併科新臺幣二百四十萬元以下罰金
(C)三年以下有期徒刑、拘役或科或併科新臺幣二百四十萬元以下罰金
(D)三年以下有期徒刑、拘役或科或併科新臺幣二百萬元以下罰金
17. 期貨經紀商之業務員於電視媒體上從事解盤分析時，明知其所提供之資訊為不實且未經查證而逕對投資大眾為浮誇、偏頗之宣傳或散布不實資訊者，該業務員應負之法律責任為何？
- (A)刑事責任及主管機關之行政處分
(B)僅受主管機關之處分而無刑事責任
(C)僅負刑事責任而無其他法律責任
(D)無法律責任
18. 有關期貨顧問事業業務範圍之規定，以下敘述何者錯誤？
- (A)證券經紀商申請兼營期貨顧問事業，得提供期貨交易、期貨信託基金、期貨相關現貨商品之交易或投資研究分析意見
(B)證券投資顧問事業申請兼營期貨顧問事業，以辦理證券相關期貨顧問業務為限
(C)未經主管機關核准經營外國有價證券受託買賣業務之證券經紀商，不得辦理國外證券相關期貨顧問業務
(D)經主管機關核准經營外國有價證券投資推介顧問業務之證券投資顧問事業，得辦理國外證券相關期貨顧問業務
19. 有關期貨顧問事業相關紀錄之保存年限，下列敘述何者正確？
- (A)與委任人訂定之契約，應自委任關係消滅之日起，保存三年
(B)與委任人訂定之契約，除應自委任關係消滅之日起，保存四年外，有爭議者應保存至該爭議消除為止
(C)交易分析報告之副本、紀錄，應自提供之日起保存五年
(D)宣傳資料、廣告物及相關紀錄應保存五年
20. 有關期貨顧問事業提供研究分析意見或推介建議等顧問服務之規定，下列敘述何者錯誤？
- (A)應作成交易分析報告，載明分析基礎及根據
(B)分析意見或建議及相關資訊，於提供予委任人之前不得提供或傳遞予其他業務部門
(C)得以其他業務部門之資訊或意見為其分析基礎及根據
(D)交易分析報告之副本、紀錄，其保存方式得以電子媒體形式為之

21. 擔任下列何項職務之業務員，得於到職後三個月內參加職前訓練，不受應於執行業務前半年內參加職前訓練規定之限制？
- (A) 辦理期貨交易有關之講習
 - (B) 對期貨交易有關事項提供研究分析意見
 - (C) 內部稽核
 - (D) 於各種傳播媒體從事解盤工作
22. 有關期貨經理事業接受共同委任從事全權委託期貨交易之規定，下列敘述何者錯誤？
- (A) 應由期貨經理事業與全體共同委任人簽訂期貨交易全權委任契約
 - (B) 共同委任人數不得超過十五人
 - (C) 不得同時包括法人及自然人
 - (D) 於期貨交易全權委任契約存續期間內終止契約，須經過半數共同委任人之書面同意
23. 有關期貨經理事業為委任人編製交易報告等書件之規定，下列敘述何者錯誤？
- (A) 應每月定期編製相關交易報告等書件並送達委任人
 - (B) 報告書件包括交易紀錄及現況報告書
 - (C) 委任人委託資產之淨值，減損達原委託資產 20% 以上時，應即編製報告書件通知委任人
 - (D) 日後委任人委託資產之淨值，每較前次報告資產減損達 20% 以上時，應即編製報告書件通知委任人
24. 有關期貨信託事業募集首檔期貨信託基金之規定，以下敘述何者錯誤？
- (A) 專營期貨信託事業取得營業執照後，未於一個月內申請募集期貨信託基金者，廢止其業務之許可
 - (B) 除主管機關另有規定外，兼營期貨信託事業於經許可並完成登記後二年內，未申請募集期貨信託基金者，廢止兼營業務之許可
 - (C) 專營期貨信託事業應於第一檔期貨信託基金募集核准函送達日起一個月內開始募集
 - (D) 專營期貨信託事業之第一檔期貨信託基金應自開始募集日起四十五日內募集成立
25. 下列有關期貨信託基金銷售之敘述，何者有誤？
- (A) 期貨信託事業應於申購人申購期貨信託基金後，立即提供風險預告書，並指派專人向申購人告知期貨信託基金之性質及可能之風險
 - (B) 期貨信託事業銷售期貨信託基金之宣傳資料、廣告物及相關紀錄應保存二年
 - (C) 對符合一定資格條件之人募集期貨信託基金，募集銷售期間，不得為一般性廣告或公開勸誘之行為
 - (D) 對不特定人為廣告、公開說明會及其他營業促銷活動時，不得為期貨信託基金績效之預測
26. 下列有關期貨信託基金投資比率規範之敘述，何者有誤？
- (A) 證券投資信託事業或信託業募集發行之基金，如從事期貨交易超過主管機關所定一定比率，應申請兼營期貨信託事業
 - (B) 期貨信託事業運用期貨信託基金持有有價證券總市值超過主管機關規定之比率時，應申請兼營證券投資信託事業
 - (C) 兼營證券投資信託事業之期貨信託事業，其所募集之期貨信託基金持有有價證券總市值即可超過主管機關規定之比率
 - (D) 對符合一定資格條件之人募集之期貨信託基金持有有價證券總市值超過主管機關規定之比率時，亦應申請兼營證券投資信託事業
27. 下列有關期貨信託基金公開說明書上傳及交付之規定，何者有誤？
- (A) 期貨信託事業募集期貨信託基金，除對符合一定資格條件之人募集期貨信託基金者外，應於本期期貨信託基金開始募集之日起三日前，依主管機關規定之格式以電子檔方式傳送至主管機關指定之資訊申報網站，並應以書面備置於其營業處所及其銷售機構營業處所
 - (B) 追加募集之期貨信託基金應於主管機關核准函送達之日起三日內傳送至主管機關指定之資訊申報網站
 - (C) 期貨信託事業應交付申購人公開說明書，或經申購人之同意，依其指示之電子郵件網址傳送公開說明書予申購人
 - (D) 期貨信託事業更新公開說明書，應於更新十五日內將更新後公開說明書以書面向主管機關申報
28. 關於委任期貨商與期貨交易輔助人之規定，下列何者正確？ 1. 委任期貨商經營國內期貨經紀業務者，應具本國期貨結算機構之結算會員資格； 2. 委任期貨商每委任一家期貨交易輔助人或其分支機構時，應依本國期貨結算機構規定，繳交交割結算基金； 3. 期貨交易輔助人得接受一家以上期貨商之委任； 4. 為維持市場均衡，期貨商僅可同時委任一家期貨交易輔助人
- (A) 僅 1、3、4
 - (B) 僅 2、3
 - (C) 僅 1、2
 - (D) 僅 3、4

29. 關於期貨交易輔助人業務員之規定，下列何者正確？ 1.同時具有證券及期貨業務員資格的業務員，得同時受託從事證券及期貨買賣；2.業務員非經登記，不得執行業務；3.業務員之登記、異動，應由業務員自己辦理登記事項；4.有事實證明從事或涉及不誠信活動，顯示其不適合擔任業務員者，不得辦理登記
- (A)僅 2、3、4 (B)僅 1、3、4 (C)僅 1、2、4 (D)僅 1、2、3
30. 某甲未經主管機關之許可，私自經營期貨交易輔助業務，並為期貨經紀商招攬客戶再轉單給期貨經紀商，依我國期貨交易法之規定，該行為是否違反規定？若是，其罰則為何？
- (A)是，並可處七年以下有期徒刑，得併科新臺幣三百萬元以下罰金
(B)是，五年以下有期徒刑、拘役或併科新臺幣二百四十萬元以下罰金
(C)是，三年以下有期徒刑、拘役或科或併科新臺幣二百萬元以下罰金
(D)並未違反期貨交易法之規定
31. 依我國期貨交易法之規定，主管機關為維護公益或市場秩序得採取之措施，下列何者正確？ 1.得命令期貨交易所提出業務報告資料；2.主管機關檢查業務或財務報告資料的對象不含期貨業商業同業公會；3.關係人之範圍依商業團體法之規定；4.得命令與期貨結算機構有財務往來的關係人提出財務報告資料
- (A)僅 1、3 (B)僅 1、4 (C)僅 2、4 (D)僅 3、4
32. 依我國期貨交易法之規定，下列何人員與其事業有財務或業務往來時，主管機關為保障公益或維護市場秩序得對其財產加以檢查？ 1.期貨商的董事；2.槓桿交易商監察人的三親等親屬；3.槓桿交易商分支機構的經理；4.期貨商總經理的父母
- (A)僅 1、3 (B)僅 1、4 (C)僅 1、3、4 (D)僅 1、2、3
33. 期貨業之負責人或受雇人有違反期貨交易法或依期貨交易法所發布之命令時，主管機關得採取下列何種措施？ 1.停止其六個月以下業務之執行；2.科以新臺幣三百萬元以下罰金；3.解除其職務；4.處以三年以下有期徒刑
- (A)僅 1、2、4 (B)僅 1、3 (C)僅 2、3 (D)僅 2、3、4
34. 我國期貨交易法對於重大不法期貨交易行為之處分，下列敘述何者錯誤？
- (A)操縱期貨或其相關現貨交易價格者，處七年以下有期徒刑、拘役或科或併科新臺幣三百萬元以下罰金
(B)從事期貨交易有虛偽、詐欺或隱匿行為者，處五年以下有期徒刑、拘役或科或併科新臺幣二百四十萬元以下罰金
(C)從事期貨交易有對作行為者，處七年以下有期徒刑、拘役或科或併科新臺幣三百萬元以下罰金
(D)從事期貨內線交易者，處七年以下有期徒刑、拘役或科或併科新臺幣三百萬元以下罰金
35. 依我國期貨交易法之規定，因為期貨交易而產生的爭議進行仲裁之敘述，下列何者正確？
- (A)期貨交易所與期貨商間採強制仲裁 (B)期貨商之間採強制仲裁
(C)期貨結算機構與期貨交易所間採強制仲裁 (D)期貨結算機構與結算會員間採約定仲裁

二、申論題（共 3 題，共 30 分）

1. 臺灣期貨交易所於 104 年 7 月 20 日推出美元兌人民幣之匯率期貨契約，依規定保證金繳交之幣別為何？（5 分）交易人在交易過程中發生追繳、虧損或違約時，應如何支應應付之保證金？（5 分）
2. 依期貨商開戶徵信作業管理自律規則規定，應對交易人進行分類分級之管理。請就下列事項簡述其內容：
- (1)如何分類分級？分類後有何限制？超過限制後有何控管措施？（5 分）
(2)分級後調整限制之條件如何？（5 分）
3. 為提升對期貨交易人之專業服務，期貨交易法開放全權委託期貨交易之經理事業，請簡述全權委託交易時，期貨交易人需與哪些單位訂定何種契約？（5 分）操作過程中應編製何種表單或報告，於何時提供期貨交易人參考？（5 分）

105年第2次 期貨交易分析人員資格測驗選擇題解答

期貨法規與自律規範試題答案

1	C	2	D	3	D	4	A	5	A
6	C	7	B	8	C	9	C	10	B
11	A	12	C	13	A	14	C	15	D
16	C	17	A	18	A	19	C	20	C
21	C	22	D	23	D	24	C	25	A
26	C	27	D	28	C	29	C	30	A
31	B	32	C	33	B	34	B	35	D

衍生性商品之風險管理試題答案

1	B	2	C	3	A	4	C	5	A
6	B	7	B	8	D	9	C	10	A
11	A	12	A	13	C	14	C	15	C
16	A	17	B	18	A	19	A.B	20	C
21	C	22	B	23	A	24	B	25	A
26	C	27	D	28	A	29	B	30	D
31	A	32	B	33	A	34	B	35	A

原6/13(一)公告第19題之解答經命題委員審閱後修正為A.B均給分。

期貨、選擇權與其他衍生性商品 試題答案

1	D	2	A	3	D	4	D	5	C
6	B	7	B	8	D	9	B	10	C
11	C	12	B	13	C	14	B	15	D
16	C	17	C	18	B	19	B	20	B
21	B	22	A	23	C	24	D	25	B
26	A	27	C	28	C	29	D	30	A
31	B	32	C	33	D	34	A	35	C

總體經濟及金融市場試題答案

1	A	2	A	3	D	4	B	5	A
6	D	7	D	8	A	9	A	10	B
11	D	12	C	13	C	14	B	15	D
16	A	17	C	18	B	19	D	20	A
21	B	22	A	23	D	24	B	25	C
26	A	27	D	28	D				