

109 年第 1 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

請填應試號碼：_____

※注意：(A)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

(B)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）

- 依我國期貨交易法之規定，期貨交易包括下列哪些契約？
I. 選擇權契約 II. 期貨選擇權契約 III. 槓桿保證金契約 IV. 交割結算契約 V. 交換契約
(A) I、II、III、IV (B) I、II、III、V (C) I、II、IV、V (D) II、III、IV、V
- 依我國期貨交易法之規定，當事人約定於未來特定期間內，依約定方式交換約定標的物或其所產生現金流量之契約，係指下列哪項契約？
(A)期貨契約 (B)選擇權契約 (C)槓桿保證金契約 (D)交換契約
- 依我國期貨交易法之規定，符合主管機關規定應集中結算之期貨交易範圍涉及外匯事項者，應先會商何者同意？
(A)財政部 (B)金融監督管理委員會
(C)中央銀行 (D)經濟部
- 依我國期貨交易法之規定，期貨交易所應於其業務規則中規定之事項不包括下列何者？
(A)結算之保證金或權利金事項 (B)期貨商之管理
(C)結算制度 (D)期貨交易市場之監視
- 依我國期貨交易法之規定，會員制期貨交易所解散之事由不包括下列何者？
(A)會員大會之決議且經主管機關核准 (B)會員不滿十五人
(C)破產 (D)期貨交易所設立許可之撤銷
- 依我國期貨交易法之規定，在公司制期貨交易所交易之期貨商，應與交易所訂立下列何項契約？
(A)承受契約 (B)期貨交易全權委任契約
(C)受託辦理結算交割契約 (D)使用期貨集中交易市場契約
- 依我國期貨交易法之規定，期貨交易之結算除經主管機關核准者外，應由下列何者向期貨結算機構辦理？
(A)期貨商 (B)槓桿交易商 (C)期貨結算會員 (D)期貨服務事業
- 依我國期貨交易法之規定，下列何者非為期貨結算機構應提存之款項？
(A)賠償準備金 (B)結算保證金 (C)營業保證金 (D)特別盈餘公積(有盈餘時)
- 期貨結算機構對結算會員違反期貨結算機構章程可施予之處分有哪些？
I. 課以違約金 II. 警告 III. 停止或限制其於期貨結算機構所為結算、交割 IV. 除名
V. 撤換負責人或相關人員
(A) I、II、III、IV (B) I、II、III、V (C) I、II、IV、V (D) II、III、IV、V
- 有關期貨商受託從事期貨交易之規定，下列敘述何者錯誤？
(A)於辦理開戶時，應與期貨交易人簽訂受託契約
(B)提供帳戶供期貨交易人從事交易
(C)應於成交後即作成買賣報告書交付期貨交易人
(D)應於每月底編製對帳單分送各期貨交易人
- 有關期貨商受託從事期貨交易之規定，下列敘述何者錯誤？
(A)得與期貨交易人約定分享利益或共同承擔損失
(B)不得為期貨交易人進行非必要之交易
(C)不得未依期貨交易人委託事項或條件從事交易
(D)不得未經期貨交易人授權而擅自為其進行期貨交易

12. 下列何者為期貨商得接受委託開戶之對象？
(A)期貨同業公會之職員及聘僱人員 (B)曾因違背證券交易契約未結案且未滿五年者
(C)期貨商負責人 (D)年齡未滿二十歲者
13. 有關期貨商受託從事期貨交易之規定，下列敘述何者錯誤？
(A)應先與委託人簽訂期貨交易全權委任契約
(B)未完成開戶手續者，不得接受其委託
(C)未於期貨商指定之金融機構開立存款帳戶者，不得接受其委託
(D)除主管機關另有規定外，應依各期貨交易所規定之保證金或權利金數額先向客戶收足
14. 下列哪些專營事業得申請兼營期貨顧問事業？
I. 期貨經紀商 II. 期貨經理事業 III. 期貨信託事業 IV. 證券經紀商
V. 證券投資顧問事業 VI. 證券投資信託事業
(A) I、II、III、IV (B) I、II、IV、V (C) I、III、IV、VI (D) II、III、V、VI
15. 期貨顧問事業應依主管機關所定證券暨期貨市場各服務事業建立內部控制制度處理準則及下列何者所訂定之期貨顧問事業內部控制制度標準規範之規定，訂定內部控制制度？
(A)期貨交易所 (B)期貨結算機構 (C)期貨公會 (D)櫃檯買賣中心
16. 下列何者非為期貨顧問事業之業務員類別？
(A)對期貨交易提供研究分析意見或推介建議者
(B)為期貨顧問事業從事推廣、招攬、講習或出版業務者
(C)內部稽核
(D)法令遵循
17. 下列何者得對期貨顧問事業之業務、財務及其他必要事項進行查核？
I. 主管機關 II. 期貨交易所 III. 期貨結算機構 IV. 期貨公會
(A) I、II、III (B) I、II、IV (C) I、III、IV (D) I、II、III、IV
18. 下列何者非為期貨經理事業接受特定人委任之工作項目？
(A)保管委託資產 (B)交易或投資分析
(C)交易或投資判斷 (D)執行交易或投資
19. 期貨經理事業接受委任人全權委託期貨交易前，應提供書面資料向委任人詳細說明，下列事項何者不包括在內？
(A)交易或投資標的可能之風險及法令限制
(B)最近二年每位交易決定人員因經營全權委託期貨交易業務而發生之訴訟事件
(C)期貨經理事業最近二年度資產負債表及綜合損益表
(D)期貨經理事業當季前五年內接受全權委託交易之戶數及委託資產總額
20. 期貨經理事業接受委任人全權委託期貨交易時，應參酌哪些事項，審慎議定交易或投資基本方針與交易或投資範圍？
I. 委任人之年齡 II. 委任人之學經歷 III. 委任人之資力 IV. 委任人之交易經驗
V. 委任人之交易目的 VI. 法令限制
(A) I、II、III、IV (B) I、II、IV、V (C) II、III、IV、VI (D) III、IV、V、VI
21. 下列有關全權委託期貨交易業務委託資產保管之敘述何者錯誤？
(A)期貨經理事業得保管委任人委託資產
(B)保管機構應由委任人指定
(C)委任人為信託業或其他經主管機關核准之事業，得自行保管委託資產
(D)期貨結算機構得擔任保管機構

22. 期貨信託事業發起人中應有符合資格條件之機構，下列何者不包括在內？
- (A)成立滿三年，最近一年於全球銀行資產或淨值排名居前一千名內之銀行
(B)成立滿三年，資金運用總額達新臺幣一千億元以上之保險公司
(C)成立滿三年，淨值為新臺幣十億元之證券商
(D)成立滿三年，以公開募集方式集資之期貨基金資產總值大於新臺幣六百五十億元之基金管理機構
23. 有關期貨信託事業因應期貨信託基金鉅額受益憑證之買回，得辦理借款之敘述，下列何者錯誤？
- (A)得以期貨信託基金之資產為擔保
(B)得向金融機構辦理借款
(C)借款金額以支付買回價金缺口為限
(D)利息費用由期貨信託基金負擔
24. 下列何者不得擔任期貨信託基金之保管機構？
- (A)因違反規定，經主管機關命令期貨信託事業不得委任其擔任基金保管機構之期限屆滿者
(B)符合經主管機關認可之信用評等機構，評等達一定等級以上之信託公司
(C)符合主管機關所定條件兼營信託業務之銀行
(D)投資於該期貨信託事業已發行股份總數達百分之十以上之信託公司
25. 期貨信託基金交易及投資所得依期貨信託契約之約定應分配收益者，除經主管機關核准外，應於會計年度終了後多久內分配？
- (A)1 個月 (B)2 個月 (C)3 個月 (D)6 個月
26. 期貨交易輔助人代理期貨商接受期貨交易者開戶，應辦理之事項不包括下列何者？
- (A)提供期貨交易者受託契約等開戶資料
(B)指派登記合格之業務員向期貨交易者詳盡說明相關權利、義務及風險
(C)受託契約經期貨交易者簽名或蓋章並加註日期後即可存檔
(D)對期貨交易者進行徵信工作
27. 期貨交易輔助人應於每月 10 日以前，向主管機關申報上月份何項報表？
- (A)業務量月報表 (B)會計項目月計表 (C)財務比率月報表 (D)資產負債表
28. 期貨交易輔助人及人員不得有下列哪些行為？
- I. 收受期貨交易者任何款項 II. 依期貨交易者委託事項或條件辦理期貨交易輔助業務
III. 接受期貨交易者全權委託之交易 IV. 洩露期貨交易者之資料
V. 接受具期貨交易者委任書之代理人委託從事期貨交易
- (A) I、II、III (B) I、II、V (C) I、III、IV (D) II、III、V
29. 槓桿交易者之淨值低於新臺幣八億元時，應即向下列哪些單位申報？
- I. 主管機關 II. 期貨交易所 III. 證券櫃檯買賣中心 IV. 期貨公會
- (A) I、II、III (B) I、II、IV (C) I、III、IV (D) I、II、III、IV
30. 槓桿交易者與非專業機構投資人從事槓桿保證金契約交易，該契約不得連結哪些標的？
- I. 國內外私募之有價證券 II. 本國企業赴海外發行之有價證券
III. 國內證券投資信託事業於海外發行之受益憑證 IV. 大陸地區證券市場有價證券
- (A) I、II、III (B) I、II、IV (C) I、III、IV (D) I、II、III、IV
31. 槓桿交易者辦理下列哪些業務之業務員，得由期貨商辦理相同性質業務之業務員兼任？
- I. 研究分析 II. 結算交割 III. 內部稽核 IV. 法令遵循 V. 風險管理 VI. 主辦會計
- (A) I、II、III、IV、V (B) I、II、IV、V、VI
(C) II、III、IV、V、VI (D) I、III、IV、V、VI
32. 下列哪些行為屬於我國期貨交易法所稱之對作行為？
- I. 場外沖銷 II. 交換交易 III. 擅為交易相對人 IV. 配合交易
- (A) I、II、III (B) I、II、IV (C) I、III、IV (D) I、II、III、IV

33. 依我國期貨交易法之規定，直接或間接影響期貨或其相關現貨交易價格之操縱行為者，在偵查中自白，如自動繳交全部犯罪所得者，減輕其刑；並因而查獲其他正犯或共犯者，其刑責可獲得如何減輕？
(A)免除其刑 (B)減輕至 1/3 (C)減輕至 1/2 (D)減輕至 2/3
34. 下列哪些期貨業應向主管機關申報經會計師查核簽證之年度財務報告？
I. 期貨商 II. 槓桿交易商 III. 期貨交易輔助人 IV. 期貨顧問事業 V. 期貨經理事業
VI. 期貨信託事業
(A) I、II、III (B) I、III、IV (C) I、IV、V (D) I、V、VI
35. 下列哪些機構應建立內部控制制度？
I. 期貨交易所 II. 期貨結算機構 III. 期貨商 IV. 槓桿交易商 V. 期貨服務事業
VI. 期貨公會
(A) I、II、III、IV、V (B) I、II、III、VI
(C) III、IV、V、VI (D) I、II、III、IV、V、VI

二、申論題（共 3 題，每題 10 分，共 30 分）

1. 依我國期貨交易法之規定，請問下列違法行為之最重罰則為何？
(1)期貨信託事業之經理人，對於職務上之行為，要求期約或收受不正利益(3分)
(2)期貨信託事業之經理人，對於違背職務上之行為，要求期約或收受不正利益(3分)
(3)向期貨信託事業之經理人，關於違背職務之行為，行求期約或交付不正利益者(3分)，(4)自首者之罰則為何(1分)？
2. 期貨經理事業之經理人及業務員應為專任，但他業兼營期貨經理事業時，具期貨經理事業相關人資格者，得兼任部分期貨經理事業之職務。請問：(請以可或否回答，簡述之)
(1)證券投信託事業之總經理可否兼任期貨經理事業之專責部門主管？
(2)登記為期貨商之經紀部門主管可否兼任期貨經理事業之專責部門主管？
(3)登記為期貨商之開戶人員可否兼任期貨經理事業之推廣、招攬人員？
(4)登記為期貨顧問事業之研究分析業務員可否兼任期貨經理事業之研究分析人員？
(5)期貨信託事業之總經理可否兼任期貨經理事業之交易決定人員？
(6)登記為私募證券投資信託基金經理人可否兼任期貨經理事業之交易決定業務員？
(7)登記為向不特定人募集之期貨信託基金經理人可否兼任期貨經理事業之交易決定業務員？
(8)登記為期貨信託事業執行交易及投資人員可否兼任期貨經理事業之交易執行人員？
(9)登記為期貨商之主辦會計可否兼任期貨經理事業之主辦會計？
(10)登記為期貨商之內部稽核可否兼任期貨經理事業之內部稽核？
(每小題 1 分，共 10 分)
3. 期貨信託事業得募集發行指數股票型期貨信託基金，亦即以追蹤、模擬或複製標的指數表現，並在證券交易市場交易，且申購、買回採現金或依據期貨信託契約規定方式交付之期貨信託基金。請說明其選定之標的指數應符合哪些條件？(可就指數編製者應具備之資格、指數成分應具備之特性、指數資訊之取得、適法性...等分別論述。)(10分)

109年第1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	B	2	D	3	C	4	A	5	B
6	D	7	C	8	B	9	A	10	B
11	A	12	C	13	A	14	B	15	C
16	D	17	B	18	A	19	B	20	D
21	A	22	C	23	D	24	D	25	D
26	C	27	A	28	C	29	A	30	D
31	C	32	C	33	C	34	D	35	A

衍生性商品之風險管理試題答案

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

期貨、選擇權與其他衍生性商品 試題答案

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

總體經濟及金融市場試題答案

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