

# 106 年第 3 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）

- 依我國期貨交易法之規定，下列有關期貨主管機關之敘述何者錯誤？  
(A)期貨主管機關為金融監督管理委員會  
(B)得公告期貨商受託從事期貨交易之種類及交易所  
(C)得基於政策考量，於主管事項範圍內公告非在期貨交易所進行之期貨交易，不適用期貨交易法之規定  
(D)得逕自與國際組織，就資訊交換事項，簽訂合作協定
- 期貨市場發生足以影響市場秩序之情事時，得調整保證金額度之機構不包括下列何者？  
(A)期貨交易所  
(B)期貨結算機構  
(C)金融監督管理委員會  
(D)期貨公會
- 依我國期貨交易法之規定，下列有關期貨交易契約之敘述何者錯誤？  
(A)非經主管機關核准，不得在期貨交易所交易  
(B)除有特殊情形外，主管機關准駁之期間不得超過六個月  
(C)若涉及新臺幣與外幣間兌換，主管機關於核准時，應先會商財政部同意  
(D)若喪失經濟效益，主管機關得撤銷之
- 依我國期貨交易法之規定，主管機關得撤銷期貨交易所許可之情事，不包括下列何者？  
(A)申請設立時所檢附之文件有虛偽情事  
(B)無正當理由，取得許可證照後，三個月內未開始營業  
(C)無正當理由，已開業但自行停止營業超過三個月以上  
(D)不符公共利益
- 依我國期貨交易法之規定，若公司制期貨交易所之董事共有 21 席，其中幾席應由主管機關指派？  
(A)5  
(B)4  
(C)3  
(D)2
- 依我國期貨交易法之規定，下列有關期貨結算機構與期貨結算會員之敘述何者錯誤？  
(A)結算會員之資格，應由期貨結算機構核定  
(B)期貨交易之結算，除經主管機關核准者外，應由期貨結算會員向期貨結算機構辦理之  
(C)期貨結算機構應向期貨結算會員收取結算保證金  
(D)期貨結算會員不履行結算交割義務時，期貨結算機構得將該會員之相關帳戶，移轉於其他期貨結算會員
- 依我國期貨交易法之規定，期貨結算機構執行市場監視，發現有影響期貨市場秩序之虞者，可對結算會員採取之措施不包括下列何者？  
(A)調整結算保證金之金額  
(B)同一交易日內多次追繳結算保證金  
(C)命令了結全部或部分期貨交易契約  
(D)暫停或停止交易
- 有關期貨結算機構應提列或繳存之款項，下列敘述何者錯誤？  
(A)應提存賠償準備金  
(B)應提存交割結算基金  
(C)應繳存營業保證金  
(D)應於每年稅後盈餘項下，提列特別盈餘公積
- 除期貨交易法外，下列期貨商經營業務尚須遵守其他法規之敘述何者錯誤？  
(A)因期貨交易所生之爭議約定進行仲裁時，應遵守仲裁法之規定  
(B)對於一定金額以上或疑似洗錢之交易，應依洗錢防制法之規定辦理  
(C)經委託人授權代辦結匯手續時，應依管理外匯條例之規定辦理  
(D)憑證、單據、帳簿、表冊、紀錄、契約及相關證明文件之保存年限，依商業會計法之規定

10. 有關期貨商收取保證金之規定，下列敘述何者錯誤？  
(A)得於期貨交易所訂定之金額外，依客戶之信用狀況及其從事之交易性質，另加收保證金  
(B)保證金之額度經調整時，期貨商應通知期貨交易人立即繳交差額  
(C)國內期貨交易保證金得以現金或經主管機關核定之有價證券為之  
(D)國外期貨交易保證金除主管機關另有規定外，應以現金為之
11. 有關期貨商發起人應辦理之事項，不包括下列何項？  
(A)遇有解散或部分業務歇業時，應陳明事由向主管機關申報  
(B)於發起時一次認足最低實收資本額  
(C)於申請許可時，向主管機關指定之金融機構存入一定款項  
(D)於申請許可時，應檢具書件向主管機關申請
12. 期貨商最近3個月曾受主管機關依期貨交易法第100條所為之警告處分時，不得申請下列事項？  
I. 設置分支機構；II. 增加業務種類；III. 投資外國事業；IV. 兼營期貨顧問事業  
(A)僅 I (B)僅 I、II  
(C)僅 I、II、III (D) I、II、III、IV
13. 下列哪些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) I、III、V、VI
14. 有關期貨顧問事業可提供研究分析意見之標的，不包括下列何者？  
(A)於倫敦交易之黃金現貨 (B)於臺灣證交所交易之黃金期貨 ETF  
(C)於臺灣期貨交易所交易之臺幣黃金期貨 (D)於香港交易所交易之美元黃金期貨
15. 具備下列何項資格者，可擔任期貨顧問事業提供期貨信託基金推介建議之人員？I. 取得期貨交易分析人員資格；II. 取得期貨商業務員資格；III. 取得期貨商業務員資格並從事證券或期貨相關工作經驗2年以上  
(A)僅 I (B)僅 I、II (C)僅 I、III (D) I、II、III
16. 下列有關期貨顧問事業人員兼任之敘述，何者錯誤？  
(A)期貨經紀商登記辦理交割結算之人員，得兼任期貨顧問事業分析解盤業務員  
(B)內部稽核人員不得辦理登記範圍以外之業務  
(C)證券投資顧問事業登記辦理內部稽核之人員，得兼任期貨顧問事業內部稽核人員  
(D)期貨經紀商登記辦理開戶之人員，得兼任期貨顧問事業推廣、招攬人員
17. 下列哪些事業兼營期貨經理事業需指撥專用營運資金新臺幣1億元？I. 期貨經紀商；II. 期貨信託事業；III. 證券投資顧問事業；IV. 證券投資信託事業  
(A)僅 I、II (B)僅 I、III  
(C)僅 I、II、III (D) I、II、III、IV
18. 有關期貨經理事業資金之運用，下列敘述何者錯誤？  
(A)可購買營業用之不動產  
(B)可購買國內政府債券  
(C)非屬經營業務所需者，得貸與他人  
(D)可購買國庫券、可轉讓銀行定期存單及商業票據
19. 期貨經理事業與委任人簽訂期貨交易全權委任契約前，應參酌哪些因素，審慎與委任人約定交易或投資之範圍？I. 委任人之資力；II. 委任人之交易經驗；III. 委任人之交易目的；IV. 委任人之職業；V. 法令限制  
(A)僅 I、II、III、IV (B)僅 I、II、III、V  
(C)僅 II、III、IV、V (D) I、II、III、IV、V
20. 期貨經理事業運用全權委託資產從事期貨相關現貨商品投資，若遇交易對手退還手續費時，應如何處理？  
(A)歸期貨經理事業所有  
(B)歸保管機構所有  
(C)依契約之約定決定歸屬  
(D)作為委任人買賣成本之減少

21. 期貨信託事業分支機構可辦理之業務項目為：I. 期貨信託基金之募集與銷售；II. 研究及分析；III. 交易決定；IV. 交易執行
- (A) 僅 I  
(B) 僅 I、II  
(C) 僅 I、II、III  
(D) I、II、III、IV
22. 期貨信託事業之內部控制制度應包括哪些作業原則？I. 產品設計；II. 充分瞭解客戶；III. 短線交易防制；IV. 洗錢防制；V. 銷售行為
- (A) 僅 I、II、III、IV  
(B) 僅 II、III、IV、V  
(C) 僅 I、II、IV、V  
(D) I、II、III、IV、V
23. 指數股票型期貨信託基金所追蹤、模擬或複製之標的指數，應符合哪些條件？I. 指數編製者應具國際期貨業務經驗及財務結構健全；II. 指數應對所界定之契約標的市場具有代表性；III. 指數成分應具備分散性及流動性；IV. 指數資訊應充分揭露並易於取得；V. 無違反法令規定或不宜列為標的指數之情事
- (A) 僅 I、II、III、IV  
(B) 僅 II、III、IV、V  
(C) 僅 I、II、IV、V  
(D) I、II、III、IV、V
24. 期貨信託事業可針對符合一定資格條件之人募集期貨信託基金，該類基金之募集對象包括：I. 銀行業、信託業；II. 證券業、期貨業；III. 票券業、保險業；IV. 符合主管機關所訂條件之基金
- (A) 僅 I、II、III  
(B) 僅 II、III、IV  
(C) 僅 I、II、IV  
(D) I、II、III、IV
25. 下列有關期貨交易輔助人之敘述何者錯誤？
- (A) 僅限經營證券經紀業務者申請  
(B) 證券商兼營期貨經紀業務者，得同時申請經營期貨交易輔助業務  
(C) 證券商經營期貨交易輔助業務，應由專責部門辦理  
(D) 應訂定內部控制制度
26. 下列有關期貨交易輔助人與委任期貨商之敘述何者正確？
- (A) 期貨交易輔助人不得以自己名義從事期貨交易之招攬業務  
(B) 期貨交易輔助人得同時接受多家期貨商之委任  
(C) 期貨交易輔助人應與委任期貨商簽訂銷售契約  
(D) 期貨交易輔助人無法執行其業務時，應由其他承受之期貨交易輔助人代為辦理
27. 期貨商兼營槓桿交易商之淨值低於新臺幣八億元時，應即申報之對象不包括下列何者？
- (A) 主管機關  
(B) 期貨交易所  
(C) 期貨公會  
(D) 證券櫃檯買賣中心
28. 下列有關槓桿交易商經營槓桿交易業務之敘述何者錯誤？
- (A) 有涉及外匯業務者，應就涉及資金匯出入部分向中央銀行申請許可  
(B) 以外幣計價者，與客戶間交割款項及費用收付應以新臺幣或外幣為之  
(C) 槓桿交易商得以客戶身分向經中央銀行許可之指定銀行辦理避險交易  
(D) 槓桿交易商從事相關避險交易，其結匯事宜應依外匯收支或交易申報辦法及相關規定辦理
29. 依我國期貨交易法之規定，期貨業違反期貨交易法，主管機關得視情節輕重所施予之處分不包括下列何者？
- (A) 除名  
(B) 撤換其負責人或其他有關人員  
(C) 命令為停止六個月以內全部或一部之營業  
(D) 撤銷營業許可

30. 依我國期貨交易法之規定，得處三年以上十年以下有期徒刑之違法情事，不包括下列何者？  
(A)自行或與他人共謀，提高、維持或降低期貨部位或其相關現貨之供需者  
(B)未經許可，擅自經營期貨信託事業  
(C)從事期貨交易，有虛偽、隱匿等行為  
(D)內線交易
31. 依我國期貨交易法之規定，受到主管機關解除職務處分之期貨業受雇人，未來五年仍可擔任下列何項職務？  
(A)會員制期貨交易所發起人  
(B)期貨商業務員  
(C)期貨顧問事業總務人員  
(D)期貨經理事業經理人
32. 期貨結算會員欲辦理期貨交易之結算作業，須與期貨結算機構簽訂何項契約？  
(A)使用期貨集中交易市場契約  
(B)委任契約  
(C)期貨結算交割契約  
(D)受託辦理結算交割契約
33. 下列何項公積金或準備金之提存沒有上限？  
(A)公司制期貨交易所提列之特別盈餘公積  
(B)期貨結算機構提存之賠償準備金  
(C)期貨商提存之特別盈餘公積  
(D)期貨信託事業提撥之特別盈餘公積
34. 下列何項資金之運用範圍不包括可轉讓之銀行定期存單？  
(A)期貨結算機構賠償準備金  
(B)期貨商之自有資金  
(C)期貨經理事業之自有資金  
(D)期貨信託事業之自有資金
35. 取得期貨商業務員資格並加上 2 年證券及期貨相關工作經驗者，可從事之期貨業相關職務有：I. 期貨商內部稽核；II. 於傳播媒體解盤之期貨顧問業務員；III. 期貨經理事業之交易決定人員；IV. 期貨信託事業之內部稽核  
(A)僅 I  
(B)僅 I、II  
(C)僅 I、II、III  
(D)I、II、III、IV

## 二、申論題（共 3 題，每題 10 分，共 30 分）

1. 依期貨商管理規則規定，國內期貨交易保證金或權利金，得以現金或經主管機關核定之有價證券繳交；另外，期貨商應向主管機關指定之機構開設客戶保證金專戶，請問此處所稱之指定機構，是指哪些機構？
2. 請說明期貨顧問事業得經營之業務項目為何？
3. 106.5.31 蘋果日報報導，因匯市波動加劇，壽險業未避險外幣部位龐大，面臨較高匯率風險，以去年來說，人壽公司稅前淨利年減 22.58% 至 1,065 億元，今年則是第 1 季外匯價格變動準備金就蒸發了 254 億元，季減 58.5%。請說明，期貨相關機構(包括期貨交易所、期貨經紀商、期貨顧問事業、期貨經理事業、期貨信託事業、槓桿交易商)目前及未來可以協助國內產業避免受到匯率波動衝擊之服務項目有哪些？

# 106年第3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	D	2	D	3	C	4	D	5	C
6	A	7	D	8	B	9	C	10	B
11	A	12	D	13	B	14	D	15	C
16	A	17	B	18	C	19	B	20	D
21	A	22	B	23	B	24	D	25	B
26	A	27	C	28	B	29	A	30	B
31	C	32	C	33	A	34	A	35	A

## 衍生性商品之風險管理試題答案

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

## 期貨、選擇權與其他衍生性商品 試題答案

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

## 總體經濟及金融市場試題答案

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