

102 年第 4 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，有關外幣保證金交易（指客戶與交易商簽約繳付外幣保證金後，交易商得隨時應客戶之請求，於保證之倍數範圍內以自己之名義為客戶之計算，在外匯市場從事不同幣別間之即期或遠期買賣）之敘述，下列何者正確？
 - 該種交易係槓桿保證金交易之一種
 - 外匯指定銀行經核准辦理外匯保證金交易，應適用期貨交易法
 - 中央銀行指定外匯經紀商經核准辦理外幣保證金交易應適用期貨交易法
 - 金融機構均得自行辦理外幣保證金交易
- 依我國期貨交易法之規定，下列在臺灣期貨交易所交易之契約，其敘述何者正確？
 - 利率類契約已推出期貨契約及選擇權契約
 - 有價證券類契約已推出期貨契約及期貨選擇權契約
 - 貨幣類契約已推出期貨契約及選擇權契約
 - 商品類契約已推出期貨契約及選擇權契約
- 依我國期貨交易法規定，下列有關在期貨交易所交易之期貨契約，何者敘述有誤？
 - 期貨交易契約非經主管機關核准，不得在期貨交易所交易
 - 涉及新台幣與外幣間兌換之期貨交易契約，應先會商中央銀行同意
 - 在正常情形下，主管機關對於期貨交易契約可否在期貨交易所交易之審理期間，不得超過三個月
 - 在期貨交易所交易之期貨契約，有喪失經濟效益或不符公共利益等情事時，主管機關得撤銷之
- 依我國期貨交易法，有關公司制期貨交易所的規定，下列何者不正確？
 - 單一股東持股比例，不得超過實收資本額的百分之七
 - 公司制期貨交易所的組織，以股份有限公司為限
 - 公司制期貨交易所章程應依公司法規定
 - 股東資格及股份轉讓之限制，非經載明於章程不生效力
- 期貨商違反公司制期貨交易所之受託契約準則之規定，依據期貨交易法規定，期貨交易所對期貨商：
甲.處罰違約金；乙.停止或限制交易；丙.終止契約；丁.除名
 - 甲、乙、丙、丁
 - 僅甲、乙、丙
 - 僅乙、丙、丁
 - 僅甲、丙、丁
- 會員或期貨商不能履行結算交割義務時，期貨交易所應採下列何種措施？甲.督導承受之會員或期貨商接辦相關業務；乙.立即通知該會員或期貨商追加交割結算基金；丙.會同期貨結算機構進行專案檢查；丁.交由金融監督管理委員會進行專案檢查
 - 甲、丙
 - 乙、丙
 - 乙、丙、丁
 - 甲、丙、丁
- 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？甲.期貨結算機構之賠償準備金；乙.違約期貨結算會員之交割結算基金；丙.違約期貨結算會員繳存之結算保證金；丁.其他期貨結算會員之交割結算基金；戊.其他期貨結算會員依期貨結算機構所定之比例分擔
 - 甲、乙、丙、丁、戊
 - 乙、丙、甲、丁、戊
 - 丙、乙、丁、甲、戊
 - 乙、丙、丁、甲、戊
- 依我國期貨交易法，關於期貨結算機構所收取結算保證金之規定，下列何者正確？甲.得以現金繳交；乙.得以經核准之有價證券繳交；丙.有價證券抵繳結算保證金之比例，由期貨結算機構定之；丁.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
 - 乙、丙、丁
 - 甲、乙、丁
 - 甲、丁
 - 甲、乙、丙

9. 結算會員有逾時交割或交割不能之情事時，下列何者正確？
 (A)應於事實發生之次日前向主管機關申報
 (B)應於知悉事實發生或處理完成後五日內申報
 (C)應立即為專案輔導
 (D)應立即暫停其結算交割業務
10. 期貨結算機構應依期貨交易法第五十三條規定，一次提存賠償準備金，其後繼續提存之規定，下列何者正確？甲.於每季終了後十五日內提存；乙.於每年度終了後一個月內提存；丙.由結算交割手續費收入項下提存；丁.提存比率為百分之二十
 (A)甲、丙、丁 (B)乙、丙、丁 (C)丙、丁 (D)甲、乙、丙
11. 對於買賣報告書與對帳單之規定，下列何者不正確？
 (A)買賣報告書應於每次成交後由期貨商編製 (B)對帳單應於每月由客戶保證金保管機構編製
 (C)對帳單之記載事項由主管機關定之 (D)買賣報告書之記載事項由主管機關定之
12. 同時經營期貨經紀、期貨自營業務，且有兩家分支機構者，其最低實收資本額為何？
 (A)新台幣六億元 (B)新台幣六億三千萬元
 (C)新台幣六億五千萬元 (D)新台幣七億元
13. 非結算會員之期貨商有下列何種情事時，主管機關得命令其將所屬期貨交易人之相關帳戶，移轉至與該期貨商訂有承受契約之其他期貨商？甲.破產；乙.解散；丙.依法應停止收受期貨交易人訂單；丁.停業
 (A)僅甲、丙、丁 (B)僅甲、乙、丁 (C)僅乙、丙、丁 (D)甲、乙、丙、丁
14. 下列敘述何者不正確？
 (A)期貨商之營業保證金，應以現金、政府債券或金融債券繳存
 (B)期貨經紀商無分支機構者應於辦理公司登記後，向主管機關指定之金融機構繳存新臺幣五千萬元營業保證金
 (C)期貨自營商無分支機構者，應於辦理公司登記後，向主管機關指定之金融機構繳存新臺幣一千萬元之營業保證金
 (D)他業兼營國內股價指數期貨契約經紀業務者，須繳存新臺幣五百萬元之營業保證金
15. 期貨商發生下列何者情況時，除處理原有交易外，應立即停止收受期貨交易人訂單，並向主管機關及主管機關指定機構提出改善計畫？甲.業主權益低於最低實收資本額百分之四十；乙.調整後淨資本額少於期貨交易人未沖銷部位所需客戶保證金總額的百分之二十時；丙.業主權益低於最低實收資本額百分之二十；丁.調整後淨資本額少於期貨交易人未沖銷部位所需客戶保證金總額的百分之十五時
 (A)甲、丙 (B)乙、丁 (C)丙、丁 (D)甲、丁
16. 期貨商經營國外期貨交易業務時，下列敘述何者不正確？
 (A)本國期貨商具有國外期貨交易所會員資格者，即可自行於國外期貨交易所進行交易
 (B)經許可之外國期貨商具有國外期貨交易所結算會員資格者，自行於國外期貨交易所交易
 (C)委託經許可並已取得主管機關公告之國外期貨交易所結算會員資格者之期貨商辦理者
 (D)依經主管機關核准之方式，於國外期貨交易所進行期貨交易
17. 欲擔任期貨商下列何項職務，需同時取得專業資格及具備相關工作經驗？
 (A)期貨交易之自行買賣
 (B)期貨交易之全權委託
 (C)期貨交易之自行查核
 (D)期貨交易之內部稽核
18. 依我國期貨交易法之規定，期貨商接受期貨交易人委託時，故意詐欺期貨交易人或對其隱匿期貨交易人相關事項導致期貨交易人產生誤信行為時，該行為之法定刑罰可處多少？
 (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二百萬元以下罰金
 (D)一年以下有期徒刑、拘役或科或併科新臺幣一百八十萬元以下罰金

【請續背面作答】

19. 有關兼營期貨顧問事業者之實收資本額規定，以下敘述何者錯誤？
- (A) 證券投資顧問事業兼營者，其實收資本額應達新臺幣五千萬元
 (B) 經營全權委託投資業務之證券投資顧問事業兼營者，其實收資本額應達新臺幣一億元
 (C) 期貨經理事業兼營者，實收資本額為新臺幣一億元
 (D) 證券經紀商兼營者，實收資本額為新臺幣二億元
20. 有關期貨顧問事業資料保存年限之規定，下列敘述何者錯誤？
- (A) 宣傳資料、廣告物及相關紀錄應保存二年
 (B) 風險預告書應自簽署之日起，保存五年
 (C) 委任契約應自委任關係消滅之日起，保存五年
 (D) 交易分析報告之紀錄應自提供之日起，保存五年
21. 有關專營期貨經理事業設置分支機構之規定，下列敘述何者錯誤？
- (A) 分支機構僅得辦理期貨經理事業所得經營業務之推廣及招攬
 (B) 營業須滿一年
 (C) 最近期經會計師查核簽證之財務報告，每股淨值不低於面額
 (D) 資本額須增加新臺幣二千五百萬元
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. 依期貨經理事業管理規則之規定，期貨經理事業運用全權委託資產買賣外國有價證券之標的，不包括下列何者？
- (A) 在國內募集及銷售之境外基金
 (B) 外國證券交易所交易之股票
 (C) 外國店頭市場交易之股票
 (D) 經主管機關認可之信用評等公司評等為適當等級以上之債券
24. 依期貨經理事業管理規則之規定，有關保管機構得接受委託辦理之事項，不包括下列何者？
- (A) 期貨相關現貨商品投資之開戶
 (B) 款券之保管
 (C) 保證金與權利金之控管
 (D) 帳務之處理
25. 具有管理或經營國際期貨基金或證券投資信託基金業務經驗之基金管理機構，如欲擔任期貨信託事業之專業發起人者，該機構及其控制或從屬機構所管理以公開募集方式集資之基金資產總值至少應為多少？
- (A) 新台幣六百五十億元
 (B) 新台幣七百五十億元
 (C) 新台幣八百五十億元
 (D) 新台幣一千億元
26. 期貨信託事業為因應期貨信託基金管理辦法第七十四條第一項但書及期貨信託契約鉅額受益憑證之買回條款所規定之事由，得依規定以該期貨信託基金之資產為擔保向金融機構辦理借款，下列有關該借款之相關敘述何者為非？
- (A) 期貨信託事業辦理該借款期間，受益人申請買回應支付買回價金百分之二之買回費用
 (B) 受益人支付之買回費用應歸入期貨信託基金資產
 (C) 借款所產生之利息費用由期貨信託事業負擔
 (D) 期貨信託事業辦理該借款，其相關借款決策作業，應作成書面紀錄並建檔，至少保存三年
27. 主管機關對於期貨信託事業申請募集或追加募集之案件，有下列哪一種情況時，主管機關得不核准？甲. 本次募集之基金與現有之期貨信託基金之投資基本方針及範圍未有適當區隔或交易、投資標的顯有不當；乙. 最近一年曾受期貨交易法第一百條處分，但其違法情事已經主管機關認可具體改善；丙. 全權委託其他專業機構運用期貨信託基金且已有事實證明可透過該專業機構獲取全球交易或投資技術者；丁. 取得期貨信託事業營業執照已滿二個完整會計年度，但最近年度每股淨值低於票面金額；戊. 經主管機關一期貨交易法停止受理其募集期貨信託基金申請案件，期限尚未屆滿
- (A) 僅甲、乙、丙
 (B) 僅甲、丙、丁
 (C) 僅甲、丁、戊
 (D) 甲、乙、丙、丁、戊

28. 期貨交易輔助人接受期貨商之委任，所從事之業務不包括下列何項？
 (A)招攬期貨交易人從事期貨交易 (B)代理期貨商接受期貨交易人開戶
 (C)接受並執行期貨交易人期貨交易之委託單 (D)通知期貨交易人繳交追加保證金及代為沖銷交易
29. 關於期貨交易輔助人之規定，下列何者正確？甲.期貨商可以同時委任一家以上的期貨交易輔助人；乙.應與委任期貨商簽訂委任契約；丙.證券商經營期貨交易輔助業務，應由專責部門辦理；丁.得同時接受多家期貨商之委任
 (A)甲、乙、丁 (B)乙、丙、丁 (C)甲、丙、丁 (D)甲、乙、丙
30. 有關期貨交易輔助人業務員登記之規定，下列敘述何者錯誤？
 (A)未依規定參加職前訓練者，不得登記為期貨交易輔助人之業務員
 (B)未依規定參加職前訓練者，期貨交易輔助人之業務員登記，應予撤銷
 (C)參加在職訓練但成績不合格者，期貨交易輔助人之業務員登記，應予撤銷
 (D)未依規定參加職前訓練或在職訓練者，喪失業務員資格
31. 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
32. 主管機關為維護公眾利益或市場秩序，對於有違反期貨交易法行為之虞者，得採取之措施下列何者正確？
 甲.要求期貨交易之有關機關、團體或個人，提示有關帳簿；乙.立即暫停期貨業者之營業許可；丙.通知有關人員到達辦公處所說明；丁.立即限制期貨業者之交易數量
 (A)甲、丙 (B)乙、丙 (C)乙、丁 (D)丙、丁
33. 依我國期貨交易法之規定，若期貨商違反規定擅自挪用客戶保證金專戶內款項供其他期貨交易人進行期貨交易，主管機關如對該期貨商為停止營業之行政處分時，其最長期限為何？
 (A)三個月 (B)六個月 (C)九個月 (D)十二個月
34. 我國期貨交易法對於期貨交易違法行為之處分，下列敘述何者錯誤？
 (A)期貨交易所之職員洩漏執行職務所知悉有關期貨交易之秘密，處一年以下有期徒刑、拘役或科或併科新臺幣一百八十萬元以下罰金
 (B)期貨商業務員洩漏期貨交易人委託事項及職務上所獲悉之秘密，處三年以下有期徒刑、拘役或科或併科新臺幣二百萬元以下罰金
 (C)期貨商業務員對期貨交易人作獲利保證，處三年以下有期徒刑、拘役或科或併科新臺幣二百萬元以下罰金
 (D)期貨商業務員擅自自客戶保證金專戶內提取款項，處三年以下有期徒刑、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，有關期貨交易所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，每題10分，共30分）

- 依金融消費者保護法規定，期貨商應將交易人予以分類分級管理。試說明期貨商開戶徵信作業管理自律規則交易人開戶時期貨商應予交易人部位限制，及超過部位限制時應加收保證金之原則與加收標準。(10分)
- 依期貨交易法第63條規定，期貨商之負責人及業務員為誇大、偏頗之宣傳或散播不實資訊等計有六種行為時，應負三年以下有期徒刑、科或併科新臺幣二百萬元以下罰金。試述法條所訂六種不得為行為之任何四種。(10分)
- 試簡述期貨服務事業之種類及其業務範圍如何。(10分)

102年第4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	A	2	D	3	C	4	A	5	B
6	A	7	C	8	B	9	A	10	A
11	B	12	B	13	D	14	D	15	D
16	A	17	D	18	A	19	B	20	B
21	D	22	D	23	A	24	C	25	A
26	D	27	C	28	C	29	D	30	D
31	A	32	A	33	B	34	D	35	D

衍生性商品之風險管理試題答案

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

期貨、選擇權與其他衍生性商品 試題答案

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

第23題:經命題委員確認,原12/5公告之答案有誤,現修正解答為**均給分**。

總體經濟及金融市場試題答案

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