

# 100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）

- 依我國期貨交易法規定，下列哪些在集中市場之交易契約應受期貨交易法之規範？1.公司發行之可轉換公司債；2.股票選擇權契約；3.外匯期貨契約；4.認購售權證；5.公司自己發行之認股權  
(A)僅1、2、5 (B)僅3、4 (C)僅2、3 (D)僅2、3、4、5
- 依我國期貨交易法之規定，有關不適用期貨交易法之期貨交易之敘述，下列何者為錯誤？  
(A)主管機關公告指定辦理外匯業務之銀行所經營外幣期貨交易包括期貨契約或期貨選擇權契約，全部不適用期貨交易法  
(B)中央銀行所指定辦理外匯業務之外匯經紀商，經核准在其營業處所經營之外幣與新台幣間之各種期貨交易  
(C)主管機關核准之金融機構在其營業處所經營之期貨交易  
(D)中央銀行所指定辦理外匯業務之銀行，經核准在該行營業處所經營之外幣與外幣間之各種期貨交易
- 依我國期貨交易法，有關期貨交易所業務規則之敘述，下列何者錯誤？  
(A)業務規則應記載事項包括保證金、權利金之計算方法  
(B)業務規則應記載事項包括期貨交易市場之監督  
(C)業務規則之訂定應經主管機關核定  
(D)主管機關即使為保護公益亦不得通知期貨交易所變更業務規則
- 期貨交易所發現期貨商有下列何種情事，得對期貨商專案檢查？甲.期貨商經營不善致信用難以維持；乙.有突發事件；丙.內部稽核作業有重大缺失；丁.不能履行結算交割義務  
(A)甲、乙、丙、丁 (B)僅甲、丙、丁 (C)僅乙、丙、丁 (D)僅丙、丁
- 會員或期貨商不能履行結算交割義務時，期貨交易所應採取下列何種措施？甲.督導承受之會員或期貨商接辦相關事務；乙.立刻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.交由行政院金管會進行專案檢查  
(A)僅甲、丙 (B)僅乙、丙 (C)僅乙、丙、丁 (D)僅甲、丙、丁
- 關於期貨交易所對相關資訊之處理，下列何者不正確？  
(A)應於營業處所備置期貨交易、監視及保證金、權利金作業之相關文件，供主管機關調閱查核  
(B)期貨商之財務、業務資料因屬商業機密，故不在公布範圍  
(C)應將每日成交契約之名稱、價格、數量等資料儘速發布並於適當場所揭示  
(D)應按日製作期貨交易行情表於交易所揭示處公告
- 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？甲.拒絕其委託；乙.接受其委託但限制其交易數量；丙.接受其委託但提高保證金；丁.要求其提出適當擔保後得接受其委託  
(A)僅甲、丙 (B)僅丙、丁 (C)僅甲、丁 (D)僅甲、乙
- 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？甲.追加營業保證金；乙.限期令其改善；丙.限制其部分業務；丁.撤銷其許可  
(A)僅甲、丙、丁 (B)僅乙、丙、丁  
(C)僅甲、乙、丙 (D)僅甲、丁
- 本國證券商申請兼營期貨業務，其自有資本適足比率不得低於多少？  
(A)百分之二百 (B)百分之一百五十  
(C)百分之一百三十 (D)百分之一百
- 有關期貨商宣傳資料及廣告物之管理，下列敘述何者正確？  
(A)期貨商之宣傳資料及廣告物，其形式、內容、製作及傳播等相關事項，須遵守中華民國期貨業商業同業公會之規範  
(B)使用前應經期貨商內部稽核審核及簽名或蓋章後始可使用  
(C)應至少保存一年  
(D)期貨交易所得隨時抽查，期貨商不得拒絕

11. 依我國期貨交易法，期貨結算機構執行市場監視時，得對結算會員採取下列何種必要措施？
- (A) 開除結算會員之資格  
(B) 暫停所有期貨交易  
(C) 立即將相關帳戶移轉給其他結算會員  
(D) 調整結算保證金之金額
12. 依我國期貨交易法，期貨結算機構對不履行結算交割義務之結算會員，以事先繳存之款項支應後，下列何款項得向違約期貨結算會員追償？
- (A) 期貨結算機構之賠償準備金  
(B) 其他期貨結算會員依期貨結算機構所定比例分擔之金額  
(C) 其他期貨結算會員之交割結算基金  
(D) 選項(A)、(B)、(C)皆是
13. 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？ 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
- (A) 僅乙、丙、丁 (B) 僅甲、乙、丁 (C) 僅甲、丁 (D) 僅甲、乙、丙
14. 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？ 甲.限制其交易數量；乙.課以違約金；丙.停止或限制其於期貨結算機構所為結算、交割；丁.命令該結算會員追加交割結算基金
- (A) 僅甲、丁 (B) 僅丙、丁 (C) 僅乙、丙 (D) 僅甲、丙
15. 期貨商發生下列何種情況時，除處理原有交易外，應即停止收受期貨交易人新單，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) 僅甲、丙 (B) 僅乙、丁 (C) 僅丙、丁 (D) 僅甲、丁
16. 某甲於 2005 年 5 月曾參加期貨商業務員職前訓練，另於 2006 年 12 月通過期貨經理業務員職前訓練並轉任期貨經理業務員，若打算於 2008 年 10 月回任期貨商業務員，請問某甲依規定應參加下列何項訓練才能確保登記之有效性？
- (A) 於 2008 年 12 月前參加期貨商業務員職前訓練  
(B) 於 2008 年 12 月前參加期貨商業務員在職訓練  
(C) 於 2008 年 10 月回任期貨商業務員前參加期貨商業務員職前訓練  
(D) 於 2008 年 10 月回任期貨商業務員前參加期貨商在職訓練
17. 期貨商之負責人與業務員，不得有下列何種行為？ 甲.知悉期貨交易人利用他人名義從事期貨交易，仍接受委託進行交易；乙.利用他人名義或由他人利用自己名義執行業務；丙.除主管機關規定外，代理他人開戶或從事期貨交易
- (A) 僅甲、乙 (B) 僅乙、丙  
(C) 僅甲、丙 (D) 甲、乙、丙
18. 我國期貨交易法之規定，以下有關罰則的敘述，何者為錯誤？
- (A) 期貨商受託買賣主管機關公告以外之期貨交易種類的最重法定刑為有期徒刑三年  
(B) 未經主管機關許可擅自經營期貨交易所業務之最重法定刑為有期徒刑七年  
(C) 期貨商業務員利用期貨交易人帳戶進行交易之最重法定刑為有期徒刑五年  
(D) 期貨交易所董事對於職務上行為要求收受不正利益之最重法定刑為有期徒刑五年
19. 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所得採取之措施，下列何者正確？ 甲.得命令期貨交易所提出業務報告資料；乙.主管機關檢查業務或財務報告資料的對象不含期貨商業同業公會；丙.關係人之範圍依商業團體法之規定；丁.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) 僅甲、丙 (B) 僅甲、丁  
(C) 僅乙、丁 (D) 僅丙、丁
20. 依我國期貨交易法之規定，主管機關為維護市場秩序得對下列何者之財產或營業加以檢查？ 甲.期貨交易所；乙.期貨交易所之總經理；丙.期貨結算機構；丁.期貨商業同業公會之理事
- (A) 僅甲、丙 (B) 僅甲、乙、丙  
(C) 僅甲、丙、丁 (D) 甲、乙、丙、丁

【請續背面作答】

21. 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.通知有關人員到辦公處所說明；丁.立即限制期貨業者之交易數量
- (A)僅甲、丙 (B)僅乙、丙  
(C)僅乙、丁 (D)僅丙、丁
22. 依我國期貨交易法第一百零七條有關內線交易禁止之對象包括下列何者？甲.期貨結算機構之經理人；乙.主管機關之公職人員；丙.期貨信託事業之董事；丁.從前述之人獲悉消息之人
- (A)僅甲、乙 (B)僅乙、丙、丁  
(C)僅甲、乙、丙 (D)甲、乙、丙、丁
23. 某甲委託地下期貨業者從事期貨交易，請問某甲的行為將面臨期貨交易法之何項刑責？
- (A)警告  
(B)處新台幣十二萬～六十萬元之罰鍰  
(C)處三年以下有期徒刑、拘役或科或併科新台幣二百萬元以下罰金  
(D)處七年以下有期徒刑，得併科新台幣三百萬元以下罰金
24. 有關期貨顧問事業相關紀錄之保存年限，下列敘述何者錯誤？
- (A)稽核報告應至少保存五年  
(B)與委任人訂定之契約，除應自委任關係消滅之日起，保存五年外，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二年  
(D)宣傳資料、廣告物及相關紀錄應保存二年
25. 有關期貨顧問事業對委任人以外之不特定人，透過傳播媒體提供研究分析意見或推介建議等顧問服務之規範，下列敘述何者錯誤？
- (A)不得涉及個別期貨交易契約未來交易價位之研判  
(B)不得於傳播媒體從事期貨交易分析之同時，有招攬客戶之廣告行為  
(C)得以業務人員或內部研究單位等名義，從事期貨交易分析或製發書面文件  
(D)對市場之行情研判或分析，應列合理研判依據
26. 期貨經理事業接受委任人全權委託期貨交易前，應提供委任人書面資料，向委任人詳細說明之事項，不包括下列何者？
- (A)交易或投資標的之特性、可能之風險及法令限制  
(B)期貨經理事業每一從事全權委託交易決定人員之學歷與經歷  
(C)最近二年全權委託交易決定人員因從事全權委託證券投資或期貨交易業務而發生或進行中之訴訟、非訟事件之情形  
(D)期貨經理事業或其負責人受主管機關處分之情形
27. 下列何者不具備擔任期貨經理事業內部稽核人員之資格條件？
- (A)取得期貨交易分析人員資格，並在證券或期貨機構從事證券或期貨相關工作經驗一年者  
(B)取得期貨交易分析人員資格，並在證券或期貨機構從事證券或期貨相關工作經驗二年者  
(C)取得期貨業務員資格，並在證券或期貨機構從事證券或期貨相關工作經驗一年者  
(D)取得期貨業務員資格，並在證券或期貨機構從事證券或期貨相關工作經驗三年者
28. 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，廢止其營業之許可  
(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
29. 期貨信託事業之業務員從事之業務，包括：甲.辦理受益憑證之募集發行及銷售；乙.期貨交易及相關投資之研究分析；丙.基金之經營管理；丁.執行基金之交易及投資；戊.內部稽核；己.主辦會計。而期貨信託事業管理規則第四十四條訂有事業「業務部門」之副總經理、協理、經理等應具備之資格條件。上開「業務部門」係指？
- (A)僅甲部門 (B)僅甲、乙、丙、丁部門  
(C)僅甲乙丙丁戊部門 (D)選項(A)、(B)、(C)皆非

30. 依期貨信託基金管理辦法之規定，期貨信託事業對不特定人募集之期貨信託基金，須符合條件始得辦理追加募集，其中一項係以申請日前五個營業日平均已發行單位數占原申請核准發行單位數之比率作為評量之標準，請問該標準為何？
- (A)須達百分之八十五以上 (B)須達百分之九十以上  
(C)須達百分之九十五以上 (D)須達百分之百
31. 下列有關操作期貨信託基金之敘述，何者有誤？
- (A)除對符合一定資格條件之人募集，其期貨信託契約另有約定者外，每一期貨信託基金出借所持有任一有價證券數額不得超過所持有該有價證券數額之百分之五十  
(B)期貨信託事業運用期貨信託基金交易或投資，應依據分析報告作成決定書，交付執行時作成執行紀錄，並按季提出檢討報告  
(C)期貨信託事業運用期貨信託基金投資國外有價證券者，得委託國外顧問專業機構間接向國外證券商委託交易  
(D)對符合一定資格條件人募集之期貨信託基金從事店頭市場衍生性商品交易，其交易之總風險曝露，除主管機關核准外，不得超過本期貨信託基金淨資產價值之百分之十
32. 期貨交易輔助人執行其期貨交易輔助之業務時，所生之損害賠償，其責任歸屬下列何者正確？
- (A)由期貨交易輔助人單獨負全部責任  
(B)由交易人與期貨交易輔助人協議之  
(C)由期貨交易輔助人與委任期貨商連帶負賠償責任  
(D)由期貨交易輔助人與委任期貨商協議之
33. 關於委任期貨商與期貨交易輔助人之規定，下列何者正確？甲.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；乙.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；丙.期貨交易輔助人得接受一家以上期貨商之委任；丁.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)僅甲、丙、丁 (B)僅乙、丙  
(C)僅甲、乙 (D)僅丙、丁
34. 依我國期貨交法有關仲裁之規定下列何者正確？
- (A)期貨交易所可辦理仲裁  
(B)期貨商間採強制仲裁  
(C)期貨結算機構與期貨交易所間採強制仲裁  
(D)期貨商與期貨交易人間採約定仲裁
35. 關於期貨交易輔助人業務員之規定，下列何者正確？甲.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；乙.業務員非經登記，不得執行業務；丙.業務員之登記、異動，應由業務員自己辦理登記事項；丁.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)僅乙、丙、丁 (B)僅甲、丙、丁  
(C)僅甲、乙、丁 (D)僅甲、乙、丙

## 二、申論題（共 3 題，每題 10 分，共 30 分）

1. 為保護交易人權益並合理規範期貨業之服務，期貨顧問事業擬於電視傳播媒體提供分析時，在身分資格上有何限制？其分析節目於播放前後有那些自行審查與申報規定？(10 分)
2. 期貨商經營國外期貨交易時，均應依期貨商管理規則第 38 條規定進行，並應逐筆委託。請就期貨商所可採行之交易與結算流程，舉三種可行之方式。經營國外複委託業務之上手向委託期貨商收受保證金或權利金之規定為何？(10 分)
3. 為保障委託人之權益，期貨經理事業管理規則及業務操作辦法規定於操作期間若發生虧損時，應即時通知或終止契約。請簡述通知之時機與方式，及終止契約之時機與程序。(10 分)

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

## 衍生性商品之風險管理試題答案

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

## 期貨、選擇權與其他衍生性商品 試題答案

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

## 總體經濟及金融市場試題答案

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