

104 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）

- 依我國期貨交易法之規定，下列有關選擇權契約之敘述何者錯誤？
 - 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，有依約履行義務
 - 選擇權買方並無履行約定之義務
 - 臺灣期貨交易所上市之臺指選擇權即屬之
- 依我國期貨交易法之規定，下列敘述何者錯誤？
 - 主管機關為金融監督管理委員會
 - 主管機關得經行政院核准，與外國政府機關簽訂合作協定
 - 期貨商受託從事之期貨交易，其種類及交易所以行政院公告者為限
 - 非在期貨交易所進行之期貨交易，基於金融等政策考量，得經中央銀行於掌理事項範圍內公告，不適用期貨交易法之規定
- 依我國期貨交易法之規定，下列有關期貨交易所之敘述何者錯誤？
 - 期貨交易所之組織分會員制及公司制兩類
 - 公司制期貨交易所之股東不得少於七人
 - 會員制期貨交易所之組織，為非以營利為目的之社團法人
 - 公司制期貨交易所之組織，以股份有限公司為限
- 依我國期貨交易法之規定，有關會員制期貨交易所應解散之事由不包括下列何者？
 - 會員不滿七人
 - 股東大會決議
 - 破產
 - 設立許可遭撤銷
- 依我國期貨交易法之規定，下列有關公司制期貨交易所之敘述何者錯誤？
 - 公司章程應遵守公司法之規定
 - 董事、監察人至少四分之一由非股東之相關專家擔任之
 - 紀律委員會成員至少應有四分之一為在該交易所交易之期貨商
 - 應與在該交易所交易之期貨商訂立使用期貨集中交易市場契約
- 依我國期貨交易法之規定，下列有關期貨結算機構之敘述何者正確？
 - 期貨交易之結算，由期貨交易人向期貨結算機構辦理
 - 結算會員之資格，由期貨結算機構核定
 - 期貨結算機構業務規則規定事項之訂定及變更，應報經主管機關核定
 - 期貨結算機構應向期貨商收取結算保證金
- 依我國期貨交易法之規定，期貨結算機構發現有影響期貨市場秩序之虞者，得對結算會員採取必要之措施，但不包括下列何者？
 - 調整結算保證金之金額
 - 同一交易日內多次追繳結算保證金
 - 命令了結全部或部分期貨交易契約
 - 暫停交易
- 依我國期貨交易法之規定，當 A 期貨結算會員拒絕承受無法履行結算交割義務之 B 結算會員相關帳戶時，下列何者非為期貨結算機構得對 A 結算會員所採取之處置？
 - 課以違約金
 - 停止或限制交易
 - 撤銷其會員資格
 - 其他必要之處置

9. 依我國期貨交易法之規定，期貨商之名稱應標明期貨之字樣，下列何者不在此限？
(A)專營期貨經紀商 (B)專營期貨自營商 (C)兼營期貨自營商 (D)複委託期貨經紀商
10. 依我國期貨交易法之規定，下列期貨交易相關書件之記載事項，何者並非由主管機關訂定？
(A)風險預告書 (B)委託書 (C)買賣報告書 (D)出金申請書
11. 依我國期貨交易法之規定，下列有關期貨商移轉所屬期貨交易人相關帳戶之敘述何者正確？
(A)期貨商應於開業後2個月內，向期交所申報與其他期貨商簽訂之承受契約書影本
(B)主管機關得命破產之期貨商將所屬期貨交易人之相關帳戶，移轉於與該期貨商訂有承受契約之其他期貨商
(C)破產之期貨商於接獲主管機關之命令時，應於5個營業日內，移交客戶保證金專戶內款項餘額及客戶之交易明細表
(D)移轉交易人相關帳戶所生之費用，應由雙方期貨商協商分擔
12. 依期貨商管理規則之規定，期貨商應依「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「期貨商內部控制制度標準規範」之規定，訂定內部控制制度，請問「期貨商內部控制制度標準規範」由下列何者訂定？
(A)金融監督管理委員會 (B)臺灣期貨交易所
(C)經濟部商業司 (D)中華民國期貨業商業同業公會
13. 有關期貨商宣傳資料及廣告物管理之規定，下列敘述何者錯誤？
(A)使用前應經過經理人審核及簽名或蓋章
(B)應保存二年
(C)形式、內容、製作及傳播等相關事項，由臺灣期貨交易所訂定管理辦法
(D)主管機關得隨時抽查，期貨商不得拒絕或妨礙
14. 由下列何者兼營之期貨顧問事業，得針對臺灣期貨交易所上市之人民幣期貨契約，提供研究分析意見或推介建議？
(A)證券經紀商兼營 (B)證券投資顧問事業兼營
(C)期貨經理事業兼營 (D)槓桿交易商兼營
15. 由下列何者兼營之期貨顧問事業在提供期貨信託基金以外有價證券之投資顧問服務前，應先取得兼營證券投資顧問業務之營業執照？
(A)期貨自營商兼營 (B)期貨經紀商兼營 (C)期貨信託事業兼營 (D)槓桿交易商兼營
16. 期貨顧問事業應與委任人簽訂書面委任契約之內容，不包括下列何項？
(A)簽約後可要求解約之事由及期限
(B)研究分析意見或建議範圍之約定與變更
(C)期貨交易佣金之計算及交付時機
(D)契約終止後，委任人得請求退還報酬時，其退還之比例及方式，並應明定屬無法退還之費用項目及其金額或計算方式
17. 有關期貨顧問事業於大眾傳播媒體製作廣告之規定，下列敘述何者錯誤？
(A)不可宣稱期貨交易適合所有人士 (B)不可保證獲利
(C)所有對公司本身有利之事項皆不可揭示 (D)不可使用易使人認為確可獲利之文字
18. 有關期貨顧問事業於傳播媒體提供研究分析意見之規定，下列敘述何者錯誤？
(A)可說明過去一周個別期貨交易契約未平倉口數之變化
(B)得於廣告時段推出感恩回饋促銷專案
(C)可提供對於總體經濟之看法
(D)得以部門而非公司之名義從事期貨交易分析

19. 期貨經理事業管理規則所稱之業務員，不包括為期貨經理事業從事下列何項業務之人員？
(A) 講習或出版 (B) 主辦會計 (C) 交易決定 (D) 內部稽核
20. 依期貨經理事業管理規則之規定，下列何項業務毋須設置部門專責辦理？
(A) 推廣或招攬 (B) 研究分析 (C) 交易決定 (D) 內部稽核
21. 依期貨經理事業管理規則之規定，下列有關共同委任之敘述何者錯誤？
(A) 全體共同委任人須與期貨經理事業簽訂期貨交易全權委任契約
(B) 期貨交易全權委任契約應記載各共同委任人之委託資產
(C) 共同委任人不得超過 99 人
(D) 共同委任人為法人時，應以公司法定義之關係企業為限
22. 依期貨經理事業管理規則之規定，下列有關委託資產保管之敘述何者錯誤？
(A) 期貨經理事業不得以任何方式或理由保管委任人委託資產
(B) 委任人為自然人時，其委託資產應由保管機構保管
(C) 期貨經理事業應指定保管機構保管委託資產
(D) 委任人為信託業時，得自行保管委託資產
23. 有關期貨經理事業受託從事全權委託期貨交易，其交易或投資之範圍不包括下列何者？
(A) 臺灣證券交易所上市之 ETF
(B) 韓國交易所上市之 KOSPI 200 選擇權
(C) 臺灣期貨交易所上市之美元兌人民幣期貨
(D) 國內外匯指定銀行推出之外幣保證金交易
24. 依期貨信託事業管理規則之規定，期貨信託事業應將重大影響受益人權益之事項，於事實發生之日起二日內公告，向主管機關申報，但不包括下列何者？
(A) 存款不足之退票、拒絕往來或其他喪失債信情事
(B) 變更公司章程
(C) 董事長、總經理或三分之一以上董事發生變動
(D) 向不特定人募集之期貨信託基金暫停及恢復計算買回價格
25. 下列有關信託業兼營期貨信託事業，得自行保管期貨信託基金之敘述何者正確？
(A) 得保管該事業募集之所有期貨信託基金
(B) 僅得保管該事業向不特定人募集之期貨信託基金
(C) 僅得保管該事業向符合主管機關所定資格條件之人募集之期貨信託基金
(D) 得保管該事業向不特定人募集並設有信託監察人之期貨信託基金
26. 下列有關期貨信託事業人員不得兼任之敘述何者錯誤？
(A) 除主管機關核准者外，董事長不得兼任總經理
(B) 總經理不得兼任基金經理人
(C) 基金經理人不得兼任執行交易及投資之業務員
(D) 內部稽核人員不得由其他業務員兼任，亦不得由他業兼營期貨信託事業且具資格之內部稽核人員兼任
27. 依期貨信託基金管理辦法之規定，下列有關指數股票型期貨信託基金之敘述何者錯誤？
(A) 以追蹤、模擬或複製標的指數表現，並在期貨交易市場交易
(B) 應於基金名稱中明確顯示所追蹤、模擬或複製之指數或指數表現
(C) 申購、買回採現金或依據期貨信託契約規定方式交付
(D) 此類基金之期貨信託契約應載明持有標的指數之成分資訊與公布週期
28. 依期貨信託基金管理辦法之規定，期貨信託事業得對符合一定資格條件之人募集期貨信託基金，下列何者不包括在內？
(A) 壽險公司 (B) 證券投資顧問事業 (C) 槓桿交易商 (D) 期貨結算機構

29. 證券商經營期貨交易輔助業務管理規則所稱之業務員，不包括從事下列何項業務之人員？
(A)內部稽核 (B)自行查核 (C)代為沖銷交易 (D)主辦會計
30. 有關期貨交易輔助人之禁止行為，不包括下列何者？
(A)收受期貨交易人任何款項
(B)接受期貨交易人之全權委託
(C)通知期貨交易人繳交追加保證金及代為沖銷交易
(D)洩露期貨交易人之資料
31. 槓桿交易者針對非專業機構投資人所設計之槓桿保證金契約，可連結下列何種標的？
(A)國內外私募之有價證券
(B)國內證券投資信託事業於海外發行之受益憑證
(C)證券櫃檯買賣中心編製之台股相關指數
(D)新臺幣匯率
32. 槓桿交易者管理規則所稱之專業機構投資人，不包括下列何者？
(A)票券金融公司 (B)政府基金 (C)保險經紀人公司 (D)單位信託
33. 槓桿交易者中得由期貨商登記辦理自行買賣業務員兼任之職務，不包括下列何者？
(A)推介或銷售 (B)商品設計 (C)研究分析 (D)交易決定
34. 依我國期貨交易法之規定，主管機關得視情節輕重，解除相關單位負責人或受雇人之職務，但不包括下列那一單位之人員？
(A)期貨交易所 (B)期貨結算機構 (C)槓桿交易者 (D)期貨業同業公會
35. 依我國期貨交易法之規定，向期貨交易所、期貨結算機構及期貨信託事業人員，關於違背職務之行為，行求期約或交付不正利益者之最重處罰為何？
(A)處 7 年以下有期徒刑，或併科新台幣 300 萬元以下罰金
(B)處 5 年以下有期徒刑，或併科新台幣 240 萬元以下罰金
(C)處 3 年以下有期徒刑，或併科新台幣 200 萬元以下罰金
(D)處 1 年以下有期徒刑，或併科新台幣 180 萬元以下罰金

二、申論題（共 3 題，每題 10 分，共 30 分）

1. 依期貨經理事業管理規則之規定，期貨經理事業應定期及不定期編製委任人交易紀錄及現況報告書之規定為何？（10 分）
2. 請說明期貨信託事業運用對不特定人所募集之期貨信託基金，可從事交易或投資之範圍為何？（10 分）
3. 請說明槓桿交易者經營槓桿保證金契約交易業務，而有涉及外匯業務者，應就涉及資金匯出入部分向何者申請許可？（1 分）何者可就辦理是項業務違規之業者施予哪些處分？（5 分）槓桿交易者應於何時向哪些機構定期申報營業報表？（4 分）

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

衍生性商品之風險管理試題答案

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

期貨、選擇權與其他衍生性商品 試題答案

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

總體經濟及金融市場試題答案

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