

100 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）

- 期貨商受託從事之期貨交易，其種類及交易所以何單位公告者為限？
(A)台灣期貨交易所 (B)中華民國期貨商業同業公會
(C)行政院金融監督管理委員會 (D)無公告限制
- 期貨交易契約經主管機關核准後，下列何者非主管機關得撤銷之事由？
(A)喪失經濟效益 (B)不符公共利益
(C)經期貨交易所申請 (D)其他國外交易所上市相同標的之商品
- 有關期貨交易契約及其上市等規定，下列何者敘述正確？
(A)台灣期貨交易所之期貨交易契約，是由該公司自行決定後即公告上市
(B)目前國內期貨交易均在期貨交易所進行，無店頭交易者
(C)期貨交易，指依國內外期貨交易所或其他期貨市場之規則或實務，從事衍生自商品、貨幣、有價證券、利率、指數或其他利益之期貨契約、選擇權契約、期貨選擇權契約、槓桿保證金契約
(D)選項(A)、(B)、(C)皆是
- 從事期貨交易，不得有對作、虛偽、詐欺、隱匿或其他足生期貨交易人或第三人誤信之行為，前述所稱對作，不包括下列何種行為？
(A)內線交易 (B)場外沖銷
(C)交叉交易 (D)配合交易
- 期貨交易所、期貨結算機構或期貨業之負責人或受雇人，有違反期貨交易法或依期貨交易法所發布之命令者，除依期貨交易法處罰外，主管機關並得視情節輕重，解除其職務或者命令最重多少個月以下業務之停止執行？
(A)一年 (B)六個月 (C)三個月 (D)一個月
- 期貨商自客戶保證金專戶內提取款項，下列何者為不合法？
(A)依期貨交易人之指示交付剩餘保證金、權利金
(B)為期貨交易人支付必須支付之保證金、權利金或清算差額
(C)為期貨交易人支付期貨經紀商之佣金、利息或其他手續費
(D)經客戶書立同意書後借貸給其他客戶
- 期貨商有下列何種情事，應先報行政院金融監督管理委員會核准？
(A)受讓其他期貨商之全部或主要部分營業或財產
(B)期貨商或其董事、監察人、經理人、業務員、其他從業人員，因業務上關係發生訴訟、仲裁或為強制執行之債務人
(C)董事、監察人、經理人及持有公司股份超過百分之十之股東，持有股份變動
(D)變更期貨交易結算交割之期貨商
- 期貨商之行為，下列何者不合法？
(A)期貨商將許可證照，懸掛於營業處所之顯著位置
(B)期貨商為招攬業務，在報章之廣告使用圖表、公式、電腦軟體或其他期貨技術分析工具為宣傳時，未顯著說明其功能限制
(C)期貨商經營經紀及自營期貨業務者，各別獨立作業
(D)由登記合格之業務員執行業務
- 有關期貨商的財務規定，下列何者正確？
(A)期貨商得以票據轉讓之背書或提供財產供他人設定擔保
(B)期貨商負債總額扣除期貨交易人權益後，不得超過其業主權益
(C)期貨商除由他業兼營者另依有關法令規定外，已依證券交易法發行有價證券者，應依同法第四十一條規定，於每年稅後盈餘項下，提存百分之十特別盈餘公積
(D)期貨商得購置非營業用之不動產

10. 有關期貨商的財務規定，下列何者正確？
- (A)期貨商之業主權益低於最低實收資本額百分之七十，應即向行政院金融監督管理委員會指定之機構申報
 - (B)期貨商之業主權益低於最低實收資本額百分之五十，除處理原有交易外，應即停止收受期貨交易人訂單，並向行政院金融監督管理委員會提出改善計畫
 - (C)期貨商調整後淨資本額少於期貨交易人未沖銷部位所需之客戶保證金總額百分之三十時，應即向行政院金融監督管理委員會申報
 - (D)期貨商調整後淨資本額少於期貨交易人未沖銷部位所需之客戶保證金總額百分之十五時，除處理原有交易外，應即停止收受期貨交易人訂單，並向行政院金融監督管理委員會與行政院金融監督管理委員會指定之機構提出改善計畫
11. 期貨商受託從事期貨交易，下列何者錯誤？
- (A)期貨商受託從事期貨交易，委託人或其代表人、代理人當面委託者，應填寫買賣委託書但可由代理人代為簽章
 - (B)期貨商接受所屬負責人開戶從事期貨交易時，其執行程序不得優於其他客戶同種類期貨交易之委託
 - (C)期貨商受理及執行期貨交易委託時，以電話進行者，必須同步錄音存證
 - (D)期貨商受託從事期貨交易，應於成交後製作買賣報告書，交付期貨交易人簽名或蓋章
12. 期貨商直接或間接投資持股達多少以上之外國事業，不得再轉投資國內期貨相關事業？
- (A)百分之五十
 - (B)百分之四十
 - (C)百分之三十五
 - (D)百分之三十
13. 期貨經紀商及期貨經理事業兼營期貨顧問事業之規定，下列敘述何者正確？
- (A)應由專責部門辦理，並應指派兼任內部稽核之人員負責管理
 - (B)總公司應設獨立專責顧問部門，並指派專責部門主管及業務員辦理之
 - (C)經核准辦理財富管理業務之證券經紀商，其兼營期貨顧問事業依規定應設置之獨立專責顧問部門，不得與財富管理業務部門合併
 - (D)選項(A)、(B)、(C)皆是
14. 期貨經紀商經主管機關許可兼營期貨顧問事業之規定，下列何者正確？
- (A)應於辦理公司變更登記後，向符合規定之金融機構繳存營業保證金新臺幣二千萬元
 - (B)營業保證金，應以現金、國內政府債券或符合主管機關核准或認可之信用評等機構評等達一定等級以上之有價證券繳存
 - (C)繳存之營業保證金得分散存放
 - (D)選項(A)、(B)、(C)皆是
15. 期貨顧問事業之宣傳資料及廣告物之規定，下列何者正確？
- (A)由主管機關訂定管理辦法
 - (B)宣傳資料、廣告物及相關紀錄應保存三年
 - (C)同業公會得隨時抽查期貨顧問事業之宣傳資料、廣告物及相關紀錄，期貨顧問事業不得拒絕或妨礙
 - (D)選項(A)、(B)、(C)皆非
16. 期貨顧問事業之業務員之登記、異動，下列何者正確？
- (A)由期貨顧問事業之業務員向同業公會辦理
 - (B)有異動者，期貨顧問事業應於異動後七個營業日內，向同業公會申報
 - (C)不符合資格條件已登記者，應予撤銷
 - (D)離職不必辦理工作證之繳回
17. 期貨經理事業接受共同委任從事全權委託期貨交易之相關規定，下列何者錯誤？
- (A)由期貨經理事業與全體共同委任人之代表簽訂期貨交易全權委任契約
 - (B)共同委任人不得超過十五人
 - (C)不得同時包括法人及自然人
 - (D)共同委任人於期貨交易全權委任契約存續期間內終止契約，須經全體共同委任人之書面同意
18. 委任人指定之保管機構，有下列何種情事之一者，期貨經理事業應對委任人負告知義務？
- (A)期貨經理事業持有其已發行股份總數百分之五股份
 - (B)投資於期貨經理事業已發行股份總數百分之三股份
 - (C)由期貨經理事業或其代表人擔任董事或監察人
 - (D)保管機構與期貨經理事業間，未具有其他實質控制關係

【請續背面作答】

19. 期貨經理事業從業人員最遲應於到職日起多少日內依中華民國期貨業商業同業公會規定申報本人及配偶帳戶內之期貨交易部位、上市、上櫃股票及具股權性質之衍生性商品之名稱及數量？
(A)三日 (B)五日 (C)七日 (D)十日
20. 中華民國期貨業商業同業公會規定以基金績效及業績數字為廣告或促銷內容者應符合之原則，下列何者錯誤？
(A)以基金績效作為廣告者，基金需成立滿三個月以上者，即能刊登
(B)任何基金績效及業績數字（包括所提之獎項及排名）均需註明使用資料之來源及日期
(C)不得以（任何期間）基金績效數值或排名資料為廣告標題、或訴求、為任何特別標識
(D)以原計價幣別以外之其它幣別之基金績效作為廣告者，應同時揭露以相同計算基礎所換算為原幣或新臺幣之基金績效
21. 中華民國期貨業商業同業公會會員如有違反會員自律公約之規定，相關之處分程序以及內容，下列何者敘述正確？
(A)經紀律委員會三分之二委員出席，出席委員過半數通過，提報中華民國期貨業商業同業公會理事會決議
(B)處以新臺幣五十萬元以上、三千萬元以下之違約金
(C)前述違約金處分，公會只得處乙次
(D)公會會員如不服處分，不得申覆
22. 期貨信託事業之董事、監察人或持有已發行股份總數百分之五以上之股東，除主管機關另有規定外，不得擔任其他期貨信託事業之持有已發行股份總數多少以上之股東？
(A)百分之一 (B)百分之二
(C)百分之三 (D)百分之五
23. 有關期貨信託事業財務之規定，下列何者錯誤？
(A)應依規定編製財務報告，並於每會計年度終了後四個月內，公告並向主管機關申報年度財務報告
(B)期貨信託事業募集之期貨信託基金，應與其事業及基金保管機構之自有財產分別獨立
(C)期貨信託事業除信託業兼營期貨信託事業符合一定條件者外，應將期貨信託基金交由基金保管機構保管，不得自行保管
(D)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，其相關借款決策作業，應作成書面紀錄並建檔，至少保存五年
24. 期貨信託事業經核發營業執照後，應於多久內申請募集期貨信託基金；他業兼營期貨信託事業於經主管機關許可並完成登記後，應多久內申請募集期貨信託基金，否則會被廢止許可？
(A)一個月；二年 (B)三個月；二年 (C)二個月；一年 (D)六個月；一年
25. 期貨信託事業募集發行組合型期貨信託基金，下列何者正確？
(A)組合型期貨信託基金是該基金項下有數個子基金，且這些子基金投資在股價指數衍生性商品
(B)對不特定人募集發行組合型期貨信託基金，除主管機關核准外，應至少投資五檔以上子基金
(C)子基金得為向私募對象所募集之期貨信託基金
(D)選項(A)、(B)、(C)皆是
26. 期貨信託事業對不特定人募集期貨信託基金，不得委任何機構擔任期貨信託基金銷售機構？
(A)證券經紀商 (B)信託業
(C)期貨顧問事業 (D)期貨交易所
27. 有關期貨信託事業募集期貨信託基金公開說明書應行記載事項之敘述，下列何者錯誤？
(A)期貨信託基金簡介應記載經理費，無論任何種基金均無須將經理費率及收取方式以明顯字體列示
(B)期貨信託基金性質應記載期貨信託基金之設立及其依據
(C)期貨信託基金交易及投資應記載期貨信託基金交易及投資方針、範圍
(D)收益分配應記載分配之項目
28. 有關本國期貨商的設置，下列何者錯誤？
(A)期貨經紀商之最低實收資本額新臺幣二億元
(B)同時經營期貨經紀及期貨自營業務之期貨商業務員最低人數三人
(C)同時申請設置分支機構者，每設置一家分支機構，申請設置存入款項應增加新臺幣一千萬元
(D)應自行政院金融監督管理委員會許可之日起六個月內完成公司設立登記，並檢具相關書件，向該會申請核發許可證照

29. 期貨信託事業之發起人自公司設立之日起多久內，不得擔任其他期貨信託事業之發起人？
 (A)三年 (B)二年 (C)一年 (D)無時間限制
30. 期貨結算會員因期貨結算所生之債務，其債權人對該結算會員之交割結算基金有優先受償之權，最優先受償順序之債權人為何？
 (A)期貨結算機構 (B)期貨交易者 (C)期貨結算會員 (D)選項(A)、(B)、(C)皆非
31. 受任人應每日檢視每一期貨交易全權委託交易帳戶資產之淨值變化，發現淨值減損達原全權委託交易資產多少以上時，應於事實發生當日內，編製委任人交易紀錄及現況報告書，以約定方式通知委任人？另日後每達較前次報告資產淨值減損達多少以上時，亦應通知？
 (A)百分之二十；百分之十 (B)百分之十；百分之五
 (C)百分之十五；百分之十 (D)百分之二十；百分之五
32. 期貨信託事業行使期貨信託基金持有股票之投票表決權，下列何者錯誤？
 (A)除法令另有規定外，應由期貨信託事業指派該事業人員代表為之
 (B)期貨信託事業行使前項表決權，應基於受益人之最大利益，得間接參與該股票發行公司有不當之安排情事
 (C)期貨信託事業行使前項表決權，應基於受益人之最大利益，不得直接參與該股票發行公司經營
 (D)期貨信託事業於出席基金所持有股票之發行公司股東會前，應將行使表決權之評估分析作業，作成說明
33. 保證型期貨信託基金應經何機構保證？
 (A)保證機構 (B)基金保管機構 (C)信用評等機構 (D)主管機關
34. 有關期貨信託基金之終止、清算等相關規定，下列何者正確？
 (A)清算人應將清算及分配之方式向主管機關申報及公告，並通知受益人。清算程序終結後應於三個月內，將處理結果向主管機關報備，並通知保管機構
 (B)期貨信託契約終止時，期貨信託事業應於主管機關核准清算後二個月內，完成期貨信託基金之清算，並將清算後之餘額，依受益權單位數之比率分派予各受益人
 (C)期貨信託基金之清算人由期貨信託事業擔任之
 (D)選項(A)、(B)、(C)皆是
35. 期貨信託基金合併之規定，下列何者正確？
 (A)期貨信託基金合併之申請經主管機關核准後，期貨信託事業應即將規定事項公告並通知消滅及存續期貨信託基金之受益人
 (B)前述公告日至期貨信託基金合併基準日，為十個營業日
 (C)期貨信託事業應於合併基準日後五個營業日內辦理消滅期貨信託基金資產移轉與存續期貨信託基金
 (D)期貨信託基金合併之相關費用，由受益人負擔

二、申論題(共 3 題，共 30 分)

1. 請依期貨信託基金管理辦法，說明期貨信託契約、基金保管機構、受益人、受益憑證之定義？(8分)
2. 目前我國期貨市場已推出股票期貨，甲公司之股票為台灣期貨交易所上市股票期貨之標的，甲公司之董事長於公司重大消息未公開前先行買入股票期貨，該董事長行為是否違法，如有違法其罰則為何？又乙公司之股票為台灣期貨交易所上市股票期貨之標的，乙公司亦為台灣證券交易所掛牌的金融控股公司，該公司之百分之百子公司丙證券商，得否買入乙公司之股票期貨？(12分)
3. 某甲為未取得期貨商之地下期貨業者，其接受投資人乙之委託但未下單至期貨交易所，逕以市場價位與投資人成交，請問甲與乙是否違反規定？罰則為何？請分別說明之？(10分)

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

衍生性商品之風險管理試題答案

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

期貨、選擇權與其他衍生性商品 試題答案

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

總體經濟及金融市場(含產業經濟) 試題答案

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