

期貨交易分析人員測驗範圍

本項測驗應試科目分為共同科目和專業科目。

一、 **共同科目**：為「金融市場常識與職業道德」，測驗題數為100題，測驗題型採四選一單一選擇題，測驗時間為60分鐘，可以單科方式參加測驗。

※ 有關「金融市場常識與職業道德」考試之報名相關事項請至證基會金融市場常識與職業道德專區網站查詢並另行上網報名。

二、 **專業科目**：

1. 期貨法規與自律規範：

- (1) 期貨交易法。
- (2) 期貨交易法施行細則。
- (3) 期貨商管理規則。
- (4) 期貨商負責人及業務員管理規則。
- (5) 期貨顧問事業設置標準。
- (6) 期貨顧問事業管理規則。
- (7) 期貨經理事業設置標準。
- (8) 期貨經理事業管理規則。
- (9) 中華民國期貨業商業同業公會「期貨經理事業經營全權委託期貨交易業務操作辦法」。
- (10) 中華民國期貨業商業同業公會「期貨經理事業全權委託交易帳戶帳務處理要點」。
- (11) 中華民國期貨業商業同業公會「期貨經理事業內部人員從事期貨交易管理辦法」。
- (12) 中華民國期貨業商業同業公會「會員暨期貨信託基金銷售機構從事廣告業務招攬及營業促銷活動管理辦理」。
- (13) 中華民國期貨業商業同業公會「會員自律公約」。
- (14) 期貨商設置標準。
- (15) 期貨信託事業設置標準。
- (16) 期貨信託事業管理規則。
- (17) 期貨信託基金管理辦法。
- (18) 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準則。
- (19) 其他與期貨交易相關之制度、規範及國內期貨商品常識。

2. 衍生性商品之風險管理：

基礎入門知識：

- (1) 風險概論。
- (2) 專業風險的入門知識(含市場風險、信用風險、系統風險、流動性風險、模型風險、營運風險、法令風險)。
- (3) 財務會計準則第34號會計公報之避險會計(以選擇題題型為主)。

(4) 回顧測試意義及方法。5.壓力測試意義、方法及功能。

風險測度：

(5) 風險值衡量方法。

(6) 風險值。

(7) 風險值模型。

衍生性商品之風險計算：

(8) 期貨契約。

(9) 選擇權契約。

(10) 權益商品。

(11) 固定收益商品。

衍生性商品投資組合之風險計算

3. 期貨、選擇權與其他衍生性商品：

衍生性商品概念

衍生性商品訂價：

(1) 持有成本理論。

(2) Black-Scholes 公式應用。

(3) 選擇權二元樹評價法。

(4) Put-call Parity。

(5) 選擇權價格上下限。

(6) 期貨選擇權評價公式應用(含Black s公式)。

交易策略：

(7) 使用期貨的避險策略。

(8) 期貨套利策略。

(9) 選擇權避險策略(含Greek letters運用)。

(10) 選擇權套利策略。

主要衍生性商品及其現貨：

(11) 權益(equity)及其衍生性商品。

(12) 利率(interest rate)及其衍生性商品。

(13) 外匯(foreign exchange)及其衍生性商品。

(14) 商品(commodity)及其衍生性商品。

新興衍生性商品及其現貨(含信用、保險、氣候、能源)

台灣衍生性商品交易及結算實務：

(15) 交易契約規格及其相關規定。

(16) 保證金與結算制度。

(17) 交易案例分析。

4. 總體經濟及金融市場：

(1) 利率理論。

(2) 貨幣市場。

- (3) 債券市場。
- (4) 貨幣供給、銀行體系。
- (5) 中央銀行制度V.S.貨幣供給。
- (6) 貨幣需求理論V.S.貨幣流通速度。
- (7) 央行所採取的貨幣政策，主要有那幾種？
- (8) 財政政策公共投資支出與經濟景氣。
- (9) 經濟成長與景氣循環。
- (10) 國際收支及外匯市場。
- (11) 臺灣、國際金融市場發展概況。
- (12) 失業、通膨、菲力普曲線。
- (13) 物價與失業。
- (14) 利率期限結構。
- (15) 時事分析。
- (16) 總體政策之乘數分析。
- (17) 景氣訊號燈所代表之意義。