

# 市場風險分組

## 第二階段工作計畫

報告人：富邦金控風險控管部

王培煜協理

日期：中華民國九十二年九月八日

# 第二階段市場風險分組工作項目及目標

市場風險組工作項目	一 91/11 ~ 92/8	二 92/9 ~ 92/12	三 93/1 ~ 93/12	四 94/1 ~ 95/12
<p><b>1. 整體性</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>■ 分組成員教育訓練</li> <li>■ 分組成員個案報告</li> <li>■ 市場風險管理實務與工作程序研討 (Procedure Discussion)</li> </ul> <p><b>2. 業務分工小組</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>■ 內部模型法(Internal Model Approach)介紹</li> <li>■ 風險值(Risk Degree)與模型認證 (Model Validation)介紹</li> <li>■ 專案研究小組包括研究相關法令修訂， 並對主管機關做成建議</li> </ul>		<p>→</p> <p>→</p> <p>→</p>		<p>→</p> <p>→</p>

# 第二階段工作規劃架構及說明

期間：自92/9至93/12

- 分組成員教育訓練
- 分組成員個案報告事項
- 市場風險管理實務及工作程序研討
- 內部模型法(Internal Model Approach)介紹
- 風險值介紹
  - PVBP
  - Greeks
  - VaR
- 模型認證介紹
  - Back test
  - Stress Test, SPAN (Standard Portfolio Analysis of Risk)
- 小組專案研究事項

# 未來運作方式建議

- 召集方式：預計每兩週或每月召開分組共同會議一次
- 參與方式：
  - 1) 個案報告、專案研究將採任務導向
  - 2) 實務探討、教育訓練將擴大參與並特別重視實際操作

# 市場風險小組工作目標

- 市場風險管理實務交流 (Knowledge transfer)
- 加強實作經驗 (Hands-on experience)
- 建立論壇：形成社群意識 (Community sense) 並可建立社區總體營造觀念
- 將智慧財 (Intelligence property goods) 轉型為公共財 (Public goods)