

# 台灣金融研訓院



## 風險管理課程辦理計畫與情形

---

民國九十二年七月十五日



# 九十二年風險管理訓練架構

---

1. 國內經常性訓練課程
2. 國內短期研討活動
3. 國內舉辦之國際合作課程
4. 國外研習及參訪活動
5. 風險管理師聯誼會

# 國內經常性訓練課程

項次	課程名稱	班種	預計舉辦月份
1	風險管理高階班	新班	2、12
2	風險管理研習班	舊班	1、4、6、7、8、10
3	風險值(VAR)管理與應用研習班	舊班	3、6、8、9、11
4	資產負債管理研習班	舊班	3、10
5	公司治理研習班	舊班	10
6	新巴塞爾資本協定研習班	新班	3-12
7	風險管理財務數學研習班	新班	4、7、9、10
8	作業風險研習班	新班	12
9	市場風險研習班	新班	11
10	信用風險研習班	新班	10
11	信用評等研習班	新班	9、12
12	FRM考前先修班	新班	6、7、8



# 風險管理高階班課程規劃配當表

課程科目	課程時數
新巴塞爾資本協定	3
風險值之管理與運用	3
利匯率工具之運用與風險管理	3
有價證券之操作與風險管理	3
企金授信風險管理	3
消金授信風險管理	3
信用卡業務及風險管理	3
資訊系統與電子銀行之風險管理	3
作業風險管理	3
綜合座談	2
合計	29



# 風險管理研習班課程規劃配當表

課程科目	課程時數
新巴塞爾資本協定	3
銀行外匯風險管理	4
銀行利率風險管理	3
銀行流動性風險管理	3
產業風險之認識與分析	3
銀行授信風險管理	3
作業風險	3
銀行內部控制與內部稽核	3
金融機構風險管理個案研究	3
風險管理問題研討	2
合計	30



# 風險值 (VAR) 管理與應用研習班

## 課程規劃配當表

課程科目	課程時數
風險系統簡介	3
金融數理	6
市場風險	8
信用風險	4
作業、法務與會計風險	3
VAR實際運用	3
金融監管機構相關規定	3
合計	30



# 資產負債管理研習班

## 課程配當表

課程科目	課程時數
資產負債管理概述(學說、方法、政策)	3
流動性管理	3
利率敏感性管理	3
投資組合管理	3
匯率避險工具之應用	3
利率避險工具之應用	3
資產負債管理個案研究(一)	6
資產負債管理個案研究(二)	6
合計	30



# 公司治理研習班 課程規劃配當表

課程科目	課程時數
公司治理概論	3
公司治理之國際規範	2
公司治理之法律架構—公司法規	2
公司治理之法律架構—證券交易法規	3
財務資訊揭露對公司治理之影響	3
董監事會運作實務探討	3
綜合座談	2
合計	18





# 新巴塞爾資本協定研習班

## 課程規劃配當表

課程科目	課程時數
新巴塞爾資本協定基本涵義	1
市場風險	2
信用風險標準法	3
內建評等法	3
作業風險	2
監理檢視公開揭露	1
合計	12



# 風險管理財務數學研習班

## 課程規劃配當表

課程科目	課程時數
財務數學基礎	3
債券數學	3
選擇權定價理論	6
風險值理論	6
違約機率模型	3
信用風險值模型介紹	3
信用評分模型	6
合計	30



# 國內短期研討活動

項次	活動名稱	合辦機構	舉辦月份
1	菁英論壇：從新巴塞爾資本協定談銀行風險管理新紀元 (From Basel II Accord to a Comprehensive Risk Management Framework)	銀行公會	9
2	市場風險管理實戰班	IFE Asia	9
3	信用評等研討會(暫訂)	S&P、Moody's、Fitch等評等機構	規劃中
4	消費金融信用評分現況與展望	Fair Isaac	規劃中

\*另亦陸續與EDS、RiskMetrics、PWC、Deloitte Consulting、GARP、BAI等機構就風險管理相關議題，洽談合辦訓練活動可行性。



# 國內短期研討活動

## 菁英論壇：從新巴塞爾資本協定談銀行風險管理新紀元

項次	場次別	主題
1	CEO Forum	
2	Workshop A	Scope of Basel II Applications from Regulatory Perspective
3	Workshop B	The Application of Basel II IRB Approach in Credit Risk Management and Taiwan's Practical Case (已於4/18舉辦)
4	Workshop C	Strategic Implications of Basel II
5	Workshop D	Getting Ready for Basel II
6	Workshop E	Operational Risk Management
7	Workshop F	Credit Risk Management
8	Workshop G	Market Risk Management (已於4/18舉辦)



# 國內舉辦之國際合作課程

項次	課程名稱 (暫定)	預定 合辦機構	舉辦月份
1	Credit Risk Portfolio Management	Risk Management Association	12
2	Capital Management	FT Knowledge Financial Learning	規劃中



# 國外研習及參訪活動

## 辦理目的

透過赴國外相關機構研習及參訪，協助參加人員獲得國際間風險管理最新資訊、瞭解標竿機構具體實務作法，並彼此經驗交流，期使我國風險管理工作與國際接軌。

## 辦理方式

1. 國外研習
  - 由本院安排赴國外專業訓練機構或顧問公司研習
2. 國外參訪
  - 建請 銀行公會及主管機關協助安排赴BIS總部、國外金融相關機構參訪

## 經費來源

建請由 銀行公會訓練基金贊助。



# 風險管理師聯誼會

## 辦理目的

本聯誼會旨在創造風險管理專業人士資訊交流、新知分享的平台，同時發掘、培養風險管理合宜師資或研究人員。

## 活動內容

1. 座談交流
2. 讀書會
3. 專題演講

## 會員人數

正會員(已取得國際風險管理證照人士)：9名

準會員(有意取得國際風險管理證照人士)：61名



九十一年一月 迄今

新巴塞爾資本協定相關訓練活動舉辦情形

---





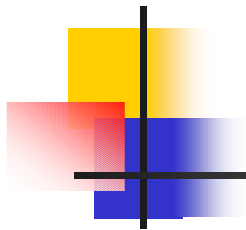
## (一) 經常性訓練班次

項次	課程名稱	各期 時數	舉辦 期次	受訓總人數
1	風險管理高階班	33	1	48
2	風險管理研習班	30	3	124
3	風險值(VAR)管理與應用研習班	30	2	85
4	資產負債管理研習班	30	1	13
5	新巴塞爾資本協定研習班	12	11	461
6	風險管理財務數學研習班	30	1	40
7	內建評等研討會(委辦)	6	1	73
8	FRM考前先修班(第一階段)	30	1	54
9	FRM考前先修班(第二階段)	36	1	47
總計		237	22	945

## (二) 短期性研討會及國外訓練課程

項次	期間	名稱	時數	參加人次
1	91/07/06	新巴塞爾資本協定及其對金融業之影響研討會	3	73
2	91/09/02	菁英論壇：信用風險管理*	7	54
3	91/11/05	銀行風險管理專題研討會	3	134
4	91/12/11	金融機構如何因應新巴塞爾資本協定研討會	2	96
5	92/01/14	新巴塞爾資本協定之評析研討會*	2	56
6	92/02/13-02/14	菁英論壇：邁向2006風險管理高峰會	8	58
7	92/02/27	QIS3後的新巴塞爾資本協定研討會	3	103
8	92/04/09	各種信用風險模型淺釋與比較研討會	3	75
9	92/04/18	Basel II 內建評等法於信用風險管理之應用	3	99
10	92/04/18	市場風險管理*	3	78
11	92/06/25	CP3後的新巴塞爾資本協定講座	3	69
12	92/06/26-06/27	消費金融信用風險管理研習會	14	61
總計			54	956

附註：\*表外籍講師授課。



敬請指導