

台灣金融研訓院



風險管理活動辦理情形與計畫

民國九十三年一月九日

本院風險管理計畫類別

金融研究

持續參與本共同研究小組研究工作

教育訓練

經常性訓練班、短期性研討會、
國外訓練課程等

傳播出版

翻譯國外風險管理相關書籍

證照測驗

代辦GARP之FRM測驗



風險管理相關活動辦理情形

(一) 經常性訓練班次 (九十二年一月 迄今)

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	2	76
2	風險管理研習班	30	5	183
3	風險值(VAR)管理與應用研習班	30	4	143
4	資產負債管理研習班	30	2	32
5	新巴塞爾資本協定研習班	14	17	741
6	風險管理財務數學研習班	30	2	84
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	2	94
9	FRM考前先修班(第二階段)	36	2	65
總計		239	37	1,491

(二) 短期性研討會及國外訓練課程(1/3)

(九十二年一月 迄今)

項次	期間	名稱	時數	參加人次
1	01/14	新巴塞爾資本協定之評析研討會*	2	56
2	02/13-02/14	菁英論壇：邁向2006風險管理高峰會	8	58
3	02/27	QIS3後的新巴塞爾資本協定研討會	3	103
4	04/09	各種信用風險模型淺釋與比較研討會	3	75
5	(1) 06/07 (2) 07/11	金融新知最前線--新巴塞爾資本協定與風險管理	2	58
6	06/25	CP3後的新巴塞爾資本協定講座	3	69
7	06/26-06/27	消費金融信用風險管理研習會	14	61
8	09/09	國外風險管理趨勢與案例介紹研討會	6	95
9	10/25	FRM(Financial Risk Manager)證照測驗說明會*	1	57
10	10/25	FRM(Financial Risk Manager)考前講座*	3	39
11	11/11	消費金融授信風險評分研討會 *	8	77
總計			51	748

附註：*表外籍講師授課。

(二) 短期性研討會及國外訓練課程(2/3)

(九十二年一月 迄今)

「菁英論壇：從新巴塞爾資本協定談銀行風險管理新紀元」系列活動

項次	舉辦期間	名稱	時數	參加人次
1	09/24-09/25	菁英論壇：從新巴塞爾資本協定談銀行風險管理新紀元*	12	104
2	09/22-09/23	Workshop A：從監理機關看新巴塞爾資本協定之應用*	9	61
3	04/18	Workshop B：Basel II內建評等法於信用風險管理之應用	3	99
4	09/26	Workshop C：Basel II 對銀行經營策略之影響*	3	84
5	09/26	Workshop D：推動Basel II之策略、挑戰與因應之道*	3	75
6	09/29	Workshop E：作業風險管理*	6	103
7	09/19	Workshop F：信用風險管理*	6	85
8	04/18	Workshop G：市場風險管理	3	78
總計			45	689

附註：*表外籍講師授課

(二) 短期性研討會及國外訓練課程(3/3)

(九十二年一月 迄今)

與銀行公會合辦「財政部金融局與中華民國銀行公會新巴塞爾資本協定共同研究小組」研究成果系列說明會

項次	舉辦日期	名稱	時數	參加人次
1	10/29	新巴塞爾資本協定之內容及其意涵研討會	3	106
2	11/05	新巴塞爾資本協定有關信用風險標準法規範說明會	3	114
3	11/12	新巴塞爾資本協定有關信用風險內部評等法規範說明會	3	113
4	11/21	新巴塞爾資本協定有關作業風險法規範說明會	3	120
5	11/26	新巴塞爾資本協定有關市場紀律與資產證券化法規範說明會	2	106
6	12/03	新巴塞爾資本協定有關監理審查法規範說明會	2	104
總計			16	663

92年1月迄今，短期性研討會及國外訓練課程共計26期次，參加人次2,100人。



(三) 金融研究

1. 研究專案：

- 提升我國金融機構競爭力系列 - 銀行風險管理調查
- 2004金融業營運趨勢展望問卷調查 - 銀行風險管理
- 持續參與金融局與銀行公會新巴塞爾資本協定共同小組專案研究

2. 風險管理觀念推廣：

- 經濟日報週日知識經濟相關專文

3. 研究出版：

- 台灣金融財務季刊第四輯第一期(92年3月)以Basel II 與金融風險管理為專題。

4. 相關研討會：

- 菁英論壇：邁向2006風險管理高峰會。

5. 圖書資訊服務：

- 持續充實風險管理相關圖書。



(四) 傳播出版

風險管理相關書籍

項次	書名
1	國家風險分析
2	金融機構的風險管理
3	企業風險管理
4	風險值(VAR)：市場風險控管之新基準
5	衍生性金融商品風險管理手冊



(五) 證照測驗 - FRM

- 金融風險管理師認證(Financial Risk Manager, FRM)是由GARP (Global Association of Risk Professionals)所頒授，為知名國際性金融專業證照之一。
- 為提供更方便的應試管道，並協助國內從業人員風險管理知能與國際接軌，本院於九十一年底接受GARP委託，代辦2003年台灣區FRM證照測驗之試務作業；並開辦相關說明會、先修課程，協助國內人員準備考試。
- 2003年台灣區FRM證照測驗報名人數達275人，相對去年僅33人報考，成長數倍。



九十三年度

風險管理相關活動舉辦計畫



九十三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. 網路課程/研討會
5. 國外研習及參訪活動
6. 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
3	風險值(VAR)管理與應用研習班	舊班	3、6、9
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	舊班	3、6、7、9、10
7	風險管理財務數學研習班	舊班	4、7
8	作業風險管理研習班	新班	4
9	市場風險管理研習班	新班	11
10	消費金融信用風險研習班	新班	6
11	企業金融信用風險研習班	新班	5
12	信用評等研習班	新班	8
13	FRM考前先修班	舊班	4~9
14	風險管理師資認證班	新班	10

國內短期研討活動

項次	活動名稱 (暫訂)	合辦機構	舉辦月份
1	衍生性金融商品風險控管		2
2	企金授信風險管理		3
3	信用評等研討會	S&P、Moody's、 Fitch等評等機構	規劃中
4	消費金融信用評分之建構與挑戰	Fair Isaac	規劃中

*將持續與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。

*將比照今年邀請Deutsche Bank及DBS Bank來台進行風險管理經驗分享之模式，嘗試洽邀其他國外標竿銀行代表，引進國外風險管理best practice.

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 Portfolio Risk Management	Risk Management Association	3
2	Credit Structures and Securitization	Euromoney Training	7

網路課程 / 研討會

項次	課程名稱 (暫定)	課程時數	舉辦月份
1	新巴塞爾資本協定簡介	1	2月起開班
2	風險值 (VAR) 管理與應用先修課程	1	3、6、9

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

九十三年預定翻譯之風險管理書籍

項次	書名	出版社
1	風險管理 (Risk Management)	McGraw Hill
2	銀行資本管理 (Managing Bank Capital)	John Wiley
3	巴塞爾資本協定與信用風險管理 (Credit Risk Models & the Basel Accords)	John Wiley



敬請指導