




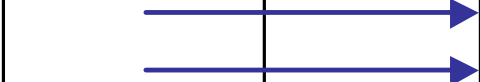
# 市場風險分組

## 第二階段工作報告暨 第三階段工作計劃

報告人：富邦金控風險控管處/ 王培煜、黃成志

日期：中華民國九十三年一月九日

# 第二、三階段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>				
				
				
				

# 第二、三階段工作架構及說明

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
- 小組專案研究事項

# 目前運作方式

- **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) 個案報告與專案研究：採取任務導向**  
**2) 教育訓練與實務探討：擴大參與並特別重視實際操作**

# 目前執行進度

- 個案報告與專案研究
- 教育訓練與實務探討

# 個案報告與專案研究(一)

## 資產負債管理

- 由中信銀吳燕玲經理講述過去於花旗銀行資產負債管理之做法提供分組成員參考

# 個案報告與專案研究(二)

## 選擇權Delta-Plus法

- 由台新銀徐偉傑經理講述Delta-Plus計提資本方法、與標準法之比較，提供分組成員參考

# 教育訓練與實務探討

## 邀請李進生教授主講風險管理概論

- 風險管理的架構
- 風險管理的實施
- 量化的風險管理
- 市場風險管理的維度
- 風險管理系統的選擇考量重點
  - 整合風險管理的範圍
  - 成本效益的考量
  - 使用效益的考量



# 總結: 市場風險分組工作目標

- 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)