

# 「證券商自有資本適足比率進階計算法訓練課程及測驗」 相關事宜

## 一、課程及測驗時間及地點

### (一) 課程

日期：109年10月7日及8日，每日09：30～16：20。

報到時間為每日上午09：00～09：30。

地點：本公司9樓會議大廳

(台北市信義路5段7號101大樓9樓)

入場時請至101大樓1樓門禁管制閘門前向本公司專人領取臨時出入證或逕自發卡機申請臨時出入證。

### (二) 測驗

日期：109年10月26日，該日09：30～12：00。

報到時間為該日09：00～09：30。

測驗當日請自行攜帶證券商自有資本適足比率進階計算法訓練教材、計算機、原子筆、修正液等文具。

地點：本公司9樓會議大廳

(台北市信義路5段7號101大樓9樓)

入場時請至101大樓1樓門禁管制閘門前向本公司專人領取臨時出入證或逕自發卡機申請臨時出入證。

## 二、訓練課程預定課程表

| 時間           | 堂次 | 第一天                 | 第二天       |
|--------------|----|---------------------|-----------|
| 09：30～10：20  | 1  | 證券商資本適足新制度<br>架構介紹  | 信用風險      |
| 10：30～11：20  | 2  | 市場風險(權益)            | 信用風險      |
| 11：30～12：20  | 3  | 市場風險(權益)            | 信用風險      |
| 午 休 ( 午餐自理 ) |    |                     |           |
| 13：30～14：20  | 4  | 市場風險(利率)            | 市場風險(選擇權) |
| 14：30～15：20  | 5  | 市場風險(利率)            | 作業風險      |
| 15：30～16：20  | 6  | 市場風險<br>(外匯、商品、集中度) | 合格自有資本    |

\*本表為預定課程，本公司將視情況予以調整課程內容。

## 三、測驗內容及型式：

本次測驗總分為 100 分，以 60 分為及格標準。測驗結果將以各證券商總公司為通知單位。

| 時間                  | 內容                   | 測驗型式   |
|---------------------|----------------------|--|
| 09：30<br> <br>12：00 | 證券商自有資本適足比率<br>進階計算法 | 選擇題、問答/計算題<br><br>(可翻閱「證券商自有資本適足比率<br>進階計算法訓練教材」作答，但不可<br>夾帶或黏貼任何紙張) |

#### 四、證券商自有資本適足比率進階計算法綜合證券商申報人員資格條件

依金融監督管理委員會之規定，經營經紀、自營及承銷三種業務之綜合證券商，辦理證券商自有資本適足比率申報作業之下列人員，應經本公司或其他經主管機關認可機構訓練及測驗合格：

- 一、內部稽核主管或風險管理單位主管至少一人。
- 二、經辦人員。

**五、報名：**本次訓練課程及測驗，務請事先辦理報名，不接受現場報名。報名時間及方式如下：

(一) 報名時間：自即日起至109年9月28日止，以報名文件送達本公司之日期為準，逾期不受理。

(二) 報名對象：

1. 報名參加訓練課程及測驗人員：由各證券商總公司彙總報名表及報名名冊。報名訓練課程者一律須參加測驗，且必須完成109年10月7日及10月8日之訓練課程，始具參加測驗之資格。
2. 僅報名參加本梯次測驗人員：曾參加108年11月19日及20日之訓練課程，惟12月3日測驗未合格者，得報名參加本梯次測驗補考。報名補考者，由各綜合證券商總公司彙總補考人員名冊，無須再行檢附報名表，併同參加本梯次訓練課程報名文件於109年9月28日前送達本公司。
3. 報名參加訓練課程、測驗之人員，一經報名將不得更換參加人員，未到者視為缺席。

### (三) 報名方式：

請各證券商總公司至本公司國內業務宣導網站 (<https://dsp.twse.com.tw>)，「券商輔導」項下之「證券商自有資本適足比率進階計算法(新制度)」專區，下載前揭報名表、報名名冊及補考人員名冊，並由總公司彙總後送交本公司券商輔導部承辦張耿榮(台北市信義路5段7號11樓)，另同時以電子郵件傳送報名名冊及補考人員名冊至1242@twse.com.tw(電子郵件主旨請註明「資本適足課程報名-券商代號及券商名稱」)。本次訓練課程及測驗，如有疑問，請洽券商輔導部承辦張耿榮，電話(02)8101-3775；張伊婷，電話(02)8101-3773。

## 六、課程講義資料

1. 本次課程不印發紙本課程教材，為利課程順利進行，請學員務必於109年9月21日起，至本公司官方網站下載更新版本教材，自行列印紙本於上課時使用，教材明細如下：
  - (1) 自有資本與風險約當金額之計算方式(進階計算法)
  - (2) 證券商自有資本適足明細申報表(進階計算法)
  - (3) 合格自有資本規範
  - (4) 課程範例
2. 測驗時僅得攜帶列印之自有資本與風險約當金額之計算方式(進階計算法)、證券商自有資本適足明細申報表(進階計算法)、合格自有資本規範，不得攜帶課程範例。