「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：**115 年 12 月 14 日及 15 日，每日 09：30～16：20。**

地　點：本公司 36 樓 3600 會議室

（台北市信義區信義路 5 段 7 號 36 樓）

因 101 辦公大樓出入管制，請於報到時間(上午 09：00～09：30) 至 101 大樓 1 樓信義路出入口向專人領取臨時出入證。

（二）測　驗

日　期：**115 年 12 月 22 日，09：30～12：00。**

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、修正帶等文具。

地　點：本公司 36 樓 3600 會議室

（台北市信義區信義路 5 段 7 號 36 樓）

因 101 辦公大樓出入管制，請於報到時間(上午 09：00～09：30) 至 101 大樓 1 樓信義路出入口向專人領取臨時出入證。

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 (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 ｜ 12：00	證券商自有資本適足比率進階計算法	選擇題、問答/計算題 （可翻閱「證券商自有資本適足比率進階計算法訓練教材」作答，但不可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，同時經營經紀、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 115 年 12 月 8 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：**由各綜合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 115 年 12 月 14 日及 15 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 114 年 12 月 15 日及 16 日之訓練課程，惟 114 年 12 月 23 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 115 年 12 月 8 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：

請各綜合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（含補考）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景勛（110615 台北市信義區信義路 5 段 7 號 10 樓），另同時以電子郵件傳送報名（含補考）人員名冊至 1223@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景勛，電話（02）8101-3793；黃韻禎，電話（02）8101-3726。

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，請學員務必於上課前至本公司官方網站下載，列印紙本教材於上課時使用，教材明細如下(與 114 年度之版本相同)：
   (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)、合格自有資本規範等「紙本」教材，且不得攜帶課程範例。