

目錄

金融風險管理 | 季刊 | Review of Financial Risk Management

94年6月 第一卷第二期

C O N T E N T S

徵稿簡則

學術論文 **Academy Papers**

- 1 Application of Quantile Regression to Estimation of Value at Risk
Mei-Yuan Chen Jau-Er Chen
- 17 短期利率之動態條件變異與預測績效之探討
The Stochastic Volatility and Predictability Efficiency of Short-Term Interest Rate
黃博怡 Bor-Yi Huang 邱哲修 Jer-Shiou Chiou
林卓民 Cho-Min Lin 陳建宏 Chien-Hung Chen
- 33 金融控股公司法實施對台灣銀行業經營效率影響之分析
*An Empirical Study on the Operational Efficiency of Taiwan's Banking Industry:
the Effect of the Financial Holding Company Act*
許鈺珊 Yu-Pei Hsu 張錫介 Hsi-Chieh Chang
- 57 原油價格風險值的估計 – 拔靴法的應用
Estimating Value-at-Risk of Oil Price Using the Bootstrapping Approach
李命志 Ming-Chih Lee 李彥賢 Yen-Hsien Lee 張智超 Chih-Chau Chang

實務論壇 **Business Forum**

- 75 公開收購的法律規範
賴英照
- 97 總體經濟因素在Basel II 資本適足率公式的內涵及意義
沈中華 賴柏志 張家華