

# 目錄

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

95年6月 第二卷第二期

## C O N T E N T S

### 學術論文 Academy Papers

- 1 相關係數可隨時間變動下的外匯期貨避險比例：簡易方法應用與其績效  
*The Hedge Ratios and Performance of Currency Futures with Time-varying Correlations*  
杜化宇 Anthony H. Tu 鍾柏婷 Karen Chung
- 31 利率風險與銀行的最適資金缺口  
*Interest Rate Risk and Optimal Gap of Bank*  
杜建衡 Chien-Heng Tu
- 47 信用違約交換評價之實證研究—TCRI信用評等資訊之應用  
*The Empirical on Valuation of Credit Default Swaps—Application of TCRI Information*  
沈大白 Da-Bai Shen 凌志銘 Chih-Ming Ling

### 實務論壇 Business Forum

- 75 考慮總體經濟因素之企業危機預警模型  
黃博怡張大成江欣怡
- 91 建立產業信用風險預測指標之研究  
朱正中

### JCIC專欄 JCIC Column

- 99 銀行推動Base1 II聯徵中心提供之服務與協助—聯徵中心「個人信用評分」之應用：  
風險區隔與風險數量化  
聯徵中心風險研究組 林思惟

徵稿簡則