

# 目錄

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

95年12月 第二卷第四期

## C O N T E N T S

### 學術論文 Academy Papers

- 1 如何區分央行不同公開市場操作策略及其對短天期利率的影響  
Effect of Daily Open Market Operation on Short-term Interest Rate: Threshold Auto-regression Model  
李卿企 *Chin Chi Lee*
- 19 區隔市場或整合市場?亞洲股市與美國及日本股市的實證研究  
Segmented Market or Integrated Market? Evidence from the Stock Markets of Four Pacific Basin Countries  
陳仕偉 *Shyh-Wei Chen* 林惠如 *Hui-Ju Lin*
- 49 利率對稱與不對稱轉嫁機制:門檻共整合模型應用  
Symmetric and Asymmetric Pass-Through Mechanisms of Interest Rates: An Application of the Threshold Cointegration Model  
王冠閔 *Kuan-Min Wang* 方文碩 *Wen-Shwo Fang*
- 73 內部評等法的回顧測試-以我國銀行業資產投資組合為例  
Backtesting Credit Portfolio on Internal Rating Based Approach- An Empirical Study on Taiwan Banking Industry  
敬永康 *Steven Ching* 張家華 *Edward Chang* 徐中敏 *Dora Hsu*

### 實務論壇 Business Forum

- 93 各國施行新巴塞爾資本協定信用風險內部評等法之申請及審查流程簡介  
黃寶慶
- 105 消費者個人信用評分之發展現況  
賴柏志

### JCIC專欄 JCIC Column

- 111 我國因應新巴塞爾資本協定所設計之第二支柱信用風險指標簡介  
與聯徵中心未來可能提供之協助說明  
聯徵中心風險研究組 黃寶慶

徵稿簡則