

行政院所屬各機關因公出國人員出國報告書
(出國類別：其他)

衍生性商品信用違約交換介紹
兼論國家風險預警機制

服務機關：中央銀行

姓名職稱：姚佳慧 (三等專員)

出國地區：新加坡

出國期間：102 年 9 月 24 日至 102 年 9 月 28 日

報告日期：102 年 12 月 16 日

目 錄

壹、前言	1
貳、信用違約交換 (Credit Default Swap, CDS)	3
一、概念.....	3
二、CDS定價.....	4
三、CDS指數.....	5
四、CDS在風險管理上的運用.....	6
參、國家風險預警機制.....	13
一、研究動機.....	13
二、研究目的.....	14
三、國家風險預警機制之風險評估指標.....	16
四、國家風險預警評估表的建立.....	35
肆、結論與建議.....	41
參考資料.....	43