

進出口業 《能力標準說明》 能力單元

「營運管理」職能範疇

名稱	制定貨幣風險策略
編號	105332L5
應用範圍	本能力單元適用於在進出口業任職，負責為管理貨幣風險而制定策略的從業員。工作亦涉及量度風險，評估並選擇風險管理方案，並建立監控匯率變動的程序。
級別	5
學分	7 (僅供參考)
能力	<p>表現要求</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. 具備外匯風險管理的知識 <ul style="list-style-type: none"> • 採用廣泛技術評估不同外匯風險，例如：轉換風險、交易風險及經濟風險 • 使用各種技能建立有效的風險監控通報系統 • 使用廣泛技術辨認及評估風險管理方案 2.1. 辨認並量度風險 <ul style="list-style-type: none"> • 進行風險評估，估計進出口業務的潛在外匯損失 • 決定可接受的風險水平，管理外匯的未來價值 2.2. 評估可選擇的風險管理方案 <ul style="list-style-type: none"> • 辨認現有的貨幣風險管理方案 • 根據已知風險，評估各方案的成效 • 選擇適當的貨幣風險管理方案 2.3. 建立監控貨幣風險的程序 <ul style="list-style-type: none"> • 為能提供最新的匯率浮動資訊而建立有效的通報系統 • 界定通報系統的權限 • 建立通報外匯浮動的程序 2.4. 制定風險管理策略 <ul style="list-style-type: none"> • 辨認使用所選方案的預期成效 • 使用風險管理策略，取得預期成效 3. 提出有效建議 <ul style="list-style-type: none"> • 評估風險管理策略對貨幣風險管理的成效 • 提出建議，改善外匯風險管理策略的成效
評核指引	<p>本能力單元的綜合成效要求為：</p> <ul style="list-style-type: none"> • 能夠找出可接受的貨幣風險水平 • 能夠評估並選擇風險管理方案 • 能為監控報告貨幣浮動而建立通報系統 • 能為管理貨幣風險而制定有效的風險管理策略
備註	