

【表6-B1】彙整表

權益證券風險-個別風險之資本計提計算表(國家別)

資料基準日： 年 月 日

銀行名稱：

銀行代號：

填表部門：

電子信箱：

填表人：

聯絡電話：

國家名稱：中華民國

單位：新台幣千元

計算項目 權益證券 及相關衍生 性商品(註2)	個別權益證券 或股價指數 (註1)		淨部位 (3)=(1)-(2)		個別風險 應計提資本 (4)= (3) ×資本計提率
	長部位 合計數(1)	短部位 合計數(2)	淨長部位 (3)>0	淨短部位 (3)<0	
資本計提率 8%					
資本計提率 20%					
合計數					

註(1):以權益證券為標的之選擇權交易若採敏感性分析法計提資本者，於計算各權益證券占該國家投資組合毛部位之百分比時，應將該選擇權之「Delta加權部位」併入計算；同時依「Delta加權部位」之正、負計入個別長部位或短部位中計算個別風險及一般市場風險。

註(2):權益證券之外幣部位應先以計算基準日之即期匯率轉換為新臺幣。

註(3):權益證券之期貨、遠期合約、交換及股價指數期貨之部位均應納入，其部位計算方式及資本之計提詳權益證券衍生性商品之相關規定。

註(4)若有任何填報疑問，請電洽本處金融穩定評估科吳專員(02-2357-1468)。