

【表G-A1】彙整表

利率風險-個別風險之資本計提計算表

資料基準日： 年 月 日

銀行名稱：

銀行代號：

填表部門：

電子信箱：

聯絡電話：

填表人：

單位：千元 幣別：NTD

項目	期限	資本計提率	資產市價		資本計提 (3)=(1)*(2)
			計提率(1)	金額(2)	
一、政府債務工具	全部	0.00%	0.00%		
1.本國中央政府及中央銀行發行、保證或擔保債務工具。					
2.各國中央政府、中央銀行發行、保證或擔保之債務工具，其外部信用評等依據信用風險標準法規定適用0%風險權數者。					
小計					
二、合格債務工具	全部	0.25% 1.00% 1.60%	0.25% 1.00% 1.60%		
1.各國中央政府、中央銀行發行、保證或擔保之債務工具，其外部信用評等依信用風險標準法規定得適用20%-50%風險權數者。					
2.非中央政府公共部門、國際復興開發銀行等多邊開發銀行發行、保證或擔保之債務工具。					
3.金控公司、銀行及票券公司發行（包括TLAC債務工具，110年12月31日以前）、保證或擔保之債務工具，其外部評等為投資等級以上者。					
4.符合下列條件之一的債務工具：					
(1) 經合格外部信用評等機構至少兩家評定為投資等級以上。					
(2) 經一個合格外部信用評等機構評定不低於投資等級，加上經其他非合格外部信用評等機構評定投資等級以上者。					
(3) 經本會核准、且銀行能說明該債券等同投資等級、同時發行人之股票在認可之證券交易所正常交易者。					
小計					
三、交易簿證券化債務工具					
1.標準法					
2.內部評等法					
小計					
四、交易簿再證券化債務工具	全部	3.20% 8.00% 18.00% 52.00% 100.00%	3.20% 8.00% 18.00% 52.00% 100.00%		
1.標準法					
2.內部評等法					
小計					
五、交易簿持有金融業資本工具					
小計					
六、其他非合格債務工具					
1.外部信評為B+以下或已有債信不良情形者（包括TLAC債務工具，自111年1月1日起）。					
2.所有其他類型之債務工具。					
小計					
合計					

註(1)：如果與債券利率有關之選擇權交易係採簡易法計提時，則該選擇權部位之個別及一般市場風險直接填入表G-E，不須填入此表。

註(2)：如果與債券利率有關之選擇權交易係採敏感性分析法計提資本時，以其Delta加權部位視為約當部位，直接併入本表，計提該選擇權之個別風險（以Delta加權部位之絕對值乘以該選擇權標的資產之個別風險資本計提率）。

註(3)：投資等級以標準普爾公司之評等為例，為BBB級或BBB級以上。

註(4)若有任何填報疑問，請電洽本處金融穩定評估科黃副科長淑君(02-2357-1464)、原靖雯(02-2357-1470)。