【表6-A1】

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：　　電子信箱：
填表部門：　　填表人：　　聯絡電話：

單位：千元　　幣別： NTD

項目	期限	資本計提率	資產市價		資本計提
			計提率(1)	金額(2)	(3)=(1)*(2)
一、政府債務工具 1.本國中央政府及中央銀行發行、保證或擔保債務工具。	全部	0.00%	0.00%		0
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。					0
小計				0	0
二、合格債務工具 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。	1.殘存期限六個月內	0.25%	0.25%		0
	2.殘存期限六個月以上至二十四個月	1.00%	1.00%		0
	3.殘存期限二十四個月以上	1.60%	1.60%		0
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。			0.25%		0
			1.00%		0
			1.60%		0
3.銀行及票券公司發行、保證或擔保之債務工具，其外部信用評等為投資等級以上者。			0.25%		0
			1.00%		0
			1.60%		0
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。			0.25%		0
			1.00%		0
			1.60%		0
小計				0	0
三、交易簿證券化債務工具 1..標準法	全部	1.60%	1.60%		0
		4.00%	4.00%		0
		8.00%	8.00%		0
		28.00%	28.00%		0
		100.00%	100.00%		0
2.內部評等法	全部	依第四部分:：市場風險之表三計提率	依第四部分:：市場風險之表三計提率		
		100.00%	100.00%		0
小計				0	0
四、交易簿再證券化債務工具 1..標準法	全部	3.20%	3.20%		0
		8.00%	8.00%		0
		18..00%	18.00%		0
		52.00%	52.00%		0
		100.00%	100.00%		0
2.內部評等法	全部	依第四部分:：市場風險之表三計提率	依第四部分:：市場風險之表三計提率		
		100.00%	100.00%		0
小計				0	0
五、交易簿持有金融業資本工具	全部	24%	24%		0
		32%	32%		0
小計				0	0
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。	全部	**12.00%** **8..00%**	**12.00%**		0
2.所有其他類型之債務工具。			**8.00%**		0
小計				0	0
合計				0	0

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6-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吳專員(02-2357-1468)。