

會計資產與槓桿比率暴險額彙總比較表

114年6月30日

(單位：新臺幣千元)

	項目	本行		合併	
		本季	前一季	本季	前一季
		114年6月30日	114年3月31日	114年6月30日	年 月 日
1	財務報表之總資產	4,068,720,028	4,158,914,501	4,096,582,404	
2	減：第一類資本扣除項中與資產項目有關之調整	(1,109,912)	(1,240,440)	(1,110,835)	
3	其中：第一類資本扣除項中評價準備提列不足數(市場風險)、營業準備及備抵呆帳提列不足數				
4	符合風險移轉認定標準作業要求的證券化暴險之調整				
5	暫時豁免計入中央銀行準備金之調整(如適用)				
6	根據銀行會計作業架構，認列於資產負債表內但不計入槓桿比率暴險總額之信託資產調整				
7	按交易日會計處理的金融資產慣例交易之調整				
8	合格資金池交易之調整				
9	衍生性金融工具之調整	14,416,597	15,673,181	14,450,517	
10	有價證券融資交易(即附買回和其他類似的擔保融通)之調整	871,406	1,134,519	871,406	
11	資產負債表表外項目之調整(即資產負債表表外暴險轉換為信用相當額)	273,661,912	277,158,330	275,418,036	
12	其他調整	(3,349,922)	(4,048,511)	(3,451,686)	
13	槓桿比率暴險總額	4,353,210,109	4,447,591,580	4,382,759,842	

槓桿比率組成項目揭露表					
114年6月30日					
(單位：新臺幣千元，%)					
	項目	本行		合併	
		本季A	前一季B	本季C	前一季D
		114年6月30日	114年3月31日	114年6月30日	年 月 日
資產負債表表內暴險					
1	資產負債表表內項目 (不含衍生性金融商品與有價證券融資交易(SFTs)，但包含前述交易表內擔保品)	4,053,102,436	4,142,784,299	4,080,859,160	
2	加回依據會計規範自資產餘額扣除所提供之衍生性金融商品擔保品				
3	減：衍生性金融商品交易因提供現金變動保證金仍帳列銀行表內資產之金額	(22,105,375)	(3,481,599)	(22,105,375)	
4	減：因有價證券融資交易而取得之有價證券已認為資產者				
5	減：第一類資本扣除項中與資產項目有關之調整	(1,109,912)	(1,240,440)	(1,110,835)	
6	其中：第一類資本扣除項中評價準備提列不足數(市場風險)、營業準備及備抵呆帳提列不足數。				
7	資產負債表表內總暴險 (不含衍生性金融商品與有價證券融資交易) (本項為第 1 項至第 5 項之加總)	4,029,887,149	4,138,062,260	4,057,642,950	
衍生性金融商品暴險					
8	所有衍生性金融商品交易相關之重置成本 (扣除合格現金價格變動保證金)	32,140,429	10,402,821	32,143,837	
9	所有衍生性金融商品交易之未來潛在暴險額	11,679,033	13,865,398	11,713,433	
10	減：因提供客戶交易清算服務而產生但得豁免計算之集中結算交易對手暴險				
11	信用保障提供人之調整後有效名目本金	2,469,930	3,154,190	2,469,930	
12	減：信用保障提供人之有效名目本金抵減數				
13	衍生性金融商品總暴險 (本項為第 8 項至第 12 項之加總)	46,289,392	27,422,409	46,327,200	
有價證券融資交易暴險					
14	有價證券融資交易資產毛額(未認列互抵)	2,500,250	3,814,062	2,500,250	
15	減：有價證券融資交易資產毛額應收應付款項抵減額				
16	有價證券融資交易資產之交易對手信用風險暴險額	871,406	1,134,519	871,406	
17	經紀交易之暴險額				
18	有價證券融資交易總暴險 (本項為第 14 項至第 17 項之加總)	3,371,656	4,948,581	3,371,656	
資產負債表表外暴險					
19	資產負債表表外暴險毛額	1,672,441,379	1,700,359,366	1,690,151,322	
20	減：轉換為信用相當額之調整數	(1,398,779,467)	(1,423,201,036)	(1,414,733,286)	
21	減：已自第一類資本扣除之資產負債表表外項目之特別準備及一般準備				
22	資產負債表表外總暴險 (本項為第19項和第21項之加總)	273,661,912	277,158,330	275,418,036	
資本與總暴險					
23	第一類資本淨額	341,542,002	343,218,611	341,541,079	
24	暴險總額 (本項為第 7 項、第 13 項、第 18 項和第 22 項之加總)	4,353,210,109	4,447,591,580	4,382,759,842	
槓桿比率					
25	槓桿比率(包含任何適用暫時豁免計入中央銀行存款準備金)(如適用)				
25a	槓桿比率(不含任何適用暫時豁免計入中央銀行存款準備金)	7.85%	7.72%	7.79%	
26	本國槓桿比率要求下限	3.00%	3.00%	3.00%	
27	適用槓桿比率緩衝				
平均值揭露					
28	有價證券融資交易資產毛額(未認列互抵)加計有價證券融資交易資產毛額應收應付款項抵減額之平均值	2,390,937	5,817,923	2,390,937	
29	有價證券融資交易資產毛額(未認列互抵)加計有價證券融資交易資產毛額應收應付款項抵減額之季末值	2,500,250	3,814,062	2,500,250	
30	納入第 28 項，有價證券融資交易資產毛額(未認列互抵)加計有價證券融資交易資產毛額應收應付款項抵減額之平均值，且包含任何適用暫時豁免計入中央銀行存款準備金之暴險總額(如適用)				
30a	納入第 28 項，有價證券融資交易資產毛額(未認列互抵)加計有價證券融資交易資產毛額應收應付款項抵減額之平均值，且不含任何適用暫時豁免計入中央銀行存款準備金之暴險總	4,353,100,796	4,449,595,441	4,382,650,529	
31	納入第 30 項，有價證券融資交易資產毛額(未認列互抵)加計有價證券融資交易資產毛額應收應付款項抵減額之平均值，且包含任何適用暫時豁免計入中央銀行存款準備金之槓桿比率(如適用)				
31a	納入第 30 項，有價證券融資交易資產毛額(未認列互抵)加計有價證券融資交易資產毛額應收應付款項抵減額之平均值，且不含任何適用暫時豁免計入中央銀行存款準備金之槓桿比率	7.85%	7.71%	7.79%	