

加權風險性資產概況(個體)

114年6月30日

(單位:新臺幣千元)

項目		風險性資產		最低資本要求
		本期A	前期B	本期C
1	信用風險(不含交易對手信用風險)(CCR)	2,203,700,919	2,398,449,111	176,296,074
2	標準法(SA)	2,203,700,919	2,398,449,111	176,296,074
3	基礎內部評等法(F-IRB)			
4	內部評等法之法定分類法(SSA)			
5	進階內部評等法(A-IRB)			
6	交易對手信用風險	5,748,091	13,118,546	459,847
7	標準法(SA-CCR)	5,748,091	13,118,546	459,847
8	內部模型法(IMM)			
9	其他交易對手信用風險			
10	信用評價調整(CVA)	2,694,638	1,819,600	
11	拆解法(look-through approach)下之基金股權投資			
12	委託基礎法(mandate-based approach)下之基金股權投資	785,329	783,250	62,826
13	備用法(fall-back approach)下之基金股權投資		34,833,962	
14	混合型之基金股權投資			
15	交割風險			
16	銀行簿之證券化暴險	13,707,168	14,804,606	1,096,573
17	內部評等法之評等基礎法(RBA)			
18	內部評等法之監理公式法(SFA)			
19	標準法	13,707,168	14,804,606	1,096,573
20	市場風險	22,653,338	28,795,438	1,812,267
21	標準法(SA)	22,653,338	28,795,438	1,812,267
22	內部模型法(IMA)			
23	交易簿和銀行簿間移轉之資本計提差額揭露			
24	作業風險	61,949,813	119,052,700	4,955,985
25	扣除門檻內之金額(適用風險權數250%)	14,129,985	14,324,055	1,130,399
26	產出下限(%)			
27	產出下限調整數			
28	總計	2,325,369,281	2,625,981,268	185,813,971
附註說明：				

加權風險性資產概況(合併)

114年6月30日

(單位:新臺幣千元)

項目		風險性資產		最低資本要求
		本期A	前期B	本期C
1	信用風險(不含交易對手信用風險)(CCR)	2,203,988,797	2,401,220,353	176,319,104
2	標準法(SA)	2,203,988,797	2,401,220,353	176,319,104
3	內部評等法(IRB)			
4	內部評等法之法定分類法(SSA)			
5	進階內部評等法(A-IRB)			
6	交易對手信用風險	5,767,522	13,141,432	461,402
7	標準法(SA-CCR)	5,767,522	13,141,432	461,402
8	內部模型法(IMM)			
9	其他交易對手信用風險			
10	信用評價調整(CVA)	2,694,854	1,819,913	215,588
11	拆解法(look-through approach)下之基金股權投資			
12	委託基礎法(mandate-based approach)下之基金股權投資	785,329	783,250	62,826
13	備用法(fall-back approach)下之基金股權投資		34,833,962	
14	混合型之基金股權投資			
15	交割風險			
16	銀行簿之證券化暴險	13,707,168	14,804,606	1,096,573
17	內部評等法之評等基礎法(RBA)			
18	內部評等法之監理公式法(SFA)			
19	標準法	13,707,168	14,804,606	1,096,573
20	市場風險	22,657,338	28,777,150	1,812,587
21	標準法(SA)	22,657,338	28,777,150	1,812,587
22	內部模型法(IMA)			
23	交易簿和銀行簿間移轉之資本計提差額揭露			
24	作業風險	62,678,363	120,407,475	5,014,269
25	扣除門檻內之金額(適用風險權數250%)	14,441,813	14,389,248	1,155,345
26	產出下限(%)			
27	產出下限調整數			
28	總計	2,326,721,184	2,630,177,389	186,137,694
附註說明：				