

簡化版基礎法—交易對手信用評價調整風險(BA-CVA)

115年6月30日

(單位：新臺幣千元)

項目		組成項目(A)	簡化版基礎法 加權風險性資產(B)
1	信用評價調整風險-系統性要素之總和	478,224	
2	信用評價調整風險-個別性要素之總和	178,186	
3	合計		2,312,238
附加說明：			

各暴險類型與風險權數分類之交易對手信用風險暴險—標準法

115 年 6 月 30 日

(單位：新臺幣千元)

風險權數 X 暴險類型		0%	2%	4%	10%	20%	30%	40%	45%	50%	75%	80%	85%	100%	130%	150%	1250%	信用暴險 額總計
1	主權國家	1,252,856																1,252,856
2	非中央政府 公共部門																	
3	銀行(含多邊 開發銀行及 集中結算交 易對手)	810,629	3,650	229,105		6,378,114	3,485,170			1,126,237				4,599,948		86,934		16,719,787
4	企業(含證券 與保險公司)					321,575				371,493	3,264,771		15,448	1,761,209				5,734,496
5	零售暴險												368,408	113,432				481,840
6	其他資產																	
7	總計	2,063,485	3,650	229,105		6,699,689	3,485,170			1,497,730	3,264,771		383,856	6,474,589		86,934		24,188,979
重大變動原因及說明：交易對手暴險額之增加，主要係美元兌新臺幣於兩期間升值所影響，外幣部位換算為新臺幣後大幅增加，導致衍生性金融商品交易組合評價正值及名目本金增加，從而使重置成本及未來潛在暴險額隨之上升，綜合導致交易對手暴險額增加。																		

信用衍生性金融商品暴險

115 年 6 月 30 日

(單位：新臺幣千元)

項目	買入保障	賣出保障
名目本金		
單一標的信用違約交換契約		2,711,500
信用違約交換指數		
總收益交換契約		
信用選擇權		
其他信用衍生性金融商品		
名目本金總計		2,711,500
公允價值		
公允價值為正值(資產)		14,815
公允價值為負值(負債)		
重大變動原因及說明：變動係因 CDS Spread 波動及剩餘期間縮短所致。		

集中結算交易對手暴險

115 年 6 月 30 日

(單位：新臺幣千元)

項目		考慮信用風險抵減後之 違約暴險額 A	風險性資產 B
1	合格集中結算交易對手暴險(總計)		9,237
2	合格集中結算交易對手交易之暴險(排除原始保證金與違約基金繳存)		
	(1) 店頭市場的衍生性金融商品	232,755	9,237
	(2) 交易所交易的衍生性金融商品		
	(3) 有價證券融資交易		
	(4) 經核准之跨商品淨額結算交易		
3	隔離的原始保證金	810,629	
4	非隔離的原始保證金		
5	預先繳存的違約基金		
6	未繳納違約基金		
7	非合格集中結算交易對手暴險(總計)		
8	非合格集中結算交易對手交易之暴險(排除原始保證金與違約基金繳存)		
	(1) 店頭市場的衍生性金融商品		
	(2) 交易所交易的衍生性金融商品		
	(3) 有價證券融資交易		
	(4) 經核准之跨商品淨額結算交易		
9	隔離的原始保證金		
10	非隔離的原始保證金		
11	預先繳存的違約基金		
12	未繳納違約基金		

重大變動原因及說明：交易對手暴險額之增加，主要係美元兌新臺幣於兩期間升值所影響，外幣部位換算為新臺幣後大幅增加，導致衍生性金融商品交易組合評價正值及名目本金增加，從而使重置成本及未來潛在暴險額隨之上升，綜合導致交易對手暴險額增加。