

表A 本國銀行壓力測試計算結果總表_輕微(Mild)情境

銀行名稱:花旗(台灣)銀行

計算基準日:98年12月31日

單位:新台幣百萬元

加權風險性資產		合格自有資本		資本適足率	
1. 信用風險	299,092	1. 第一類資本	27,237	1. 資本適足率	14.11%
2. 市場風險	14,529	2. 第二類資本	19,973	2. 第一類資本占風險性資產比率	8.14%
3. 作業風險	20,929	3. 第三類資本	-		
4. 合計	334,550	4. 合計	47,210		

估計可能損失 (A)		帳列備抵呆帳或累積減損 (B)		估計可能損失超過帳列備抵呆帳及累積減損 (C)=(A) - (B)	合格資本之變動(分子) (D)	加權風險性資產(分母) (E)		負面情境下之資本適足率(F)=(D)/(E)	
1. 信用風險	9,780	1. 帳列備抵呆帳	8,547		1. 合格資本扣除"估計可能損失超過帳列備抵呆帳及累積減損"之金額	45,525	計算基準日之加權風險性資產 334,550	1. 資本適足率	13.61%
(1) 國內授信(表B)	9,109	2. 帳列累積減損	-		2. 第一類資本扣除"估計可能損失超過帳列備抵呆帳及累積減損"之金額	25,552		2. 第一類資本占風險性資產比率	7.64%
(2) 國外授信(表C)	223								
(3) 衍生性商品交易對手信用風險(表D)	448								
(4) 投資部位(表E)	-								
2. 市場風險(表F)	231								
3. 大額曝險(表G)	221								
4. 合計	10,232	3. 合計	8,547	1,685					

填表人:

Angel

覆核:

Candy Chen

單位主管:

JYB

表A 本國銀行壓力測試計算結果總表_較嚴重 (More Adverse Alternatives) 情境

銀行名稱：花旗(台灣)銀行

計算基準日：98年12月31日

單位：新台幣百萬元

計算基準日：98年12月31日
 單位：新台幣百萬元

加權風險性資產		合格自有資本		資本適足率	
1. 信用風險	299,092	1. 第一類資本	27,237	1. 資本適足率	14.11%
2. 市場風險	14,529	2. 第二類資本	19,973	2. 第一類資本占	8.14%
3. 作業風險	20,929	3. 第三類資本	-	風險性資產比率	
4.合計	334,550	4.合計	47,210		

估計可能損失 (A)		帳列備抵呆帳或累積減損 (B)		估計可能損失超過帳列備抵呆帳及累積減損 (C)=(A) - (B)	合格資本之變動(分子) (D)		加權風險性資產(分母) (E)		負面情境下之資本適足率(F)=(D)/(E)	
1. 信用風險	13,688	1.帳列備抵呆帳	8,547	5,995	1.合格資本扣除"估計可能損失超過帳列備抵呆帳及累積減損"之金額	41,215	計算基準日之加權風險性資產 334,550		1. 資本適足率	12.32%
(1) 國內授信(表B)	12,451	2.帳列累積減損	-		2.第一類資本扣除"估計可能損失超過帳列備抵呆帳及累積減損"之金額				21,242	2. 第一類資本占風險性資產比率
(2) 國外授信(表C)	646									
(3)衍生性商品交易對手信用風險(表D)	591									
(4)投資部位(表E)	-									
2. 市場風險(表F)	417									
3.大額曝險(表G)	437									
4.合計	14,542	3. 合計	8,547							

填表人：

Angel

覆核：

Andy Chen

單位主管：

JLH