

[表 6-A] 利率風險-市場風險應計提資本彙總表

2024年09月23日

單位：(各幣別) 千元

若選擇權交易採簡易法者，以下表計算應計提資本：

幣別	個別風險	一般市場風險 資本計提(b)	匯率(c)	應計提資本總額 (新台幣) (1)=[(a)+(b)] * (c)
	資本計提(a)			
新台幣	1	2	3	9
美元	4	5	6	54
英鎊				
日幣				
合計	5	7	9	[表 1-C · (G)]

若選擇權交易採敏感性分析(Delta-plus)法者，應以下表計算應計提之資本：

選擇權交易採敏感性分析時應計提之Gamma 風險及 Vega風險之資本：(2)	
應計提資本(3)=(1)	[表 1-C · (G)]

以利率或債券為標的之選擇權交易，當採敏感性分析(Delta-plus)法計提資本者，其個別風險及一般市場風險資本之計提，除應將 Delta 加權部位分別列入表 6-A1 及表 6-A2-a (或表6-A2-b) 計提個別風險及一般市場風險之資本需求外，並應再計算 Gamma 風險之資本需求及 Vega 風險之資本需求 (表 6-E1)。