【表6-A2-a】

利率風險-一般市場風險之資本計提計算表(到期法)

資料基準日： 年 月 日

銀行名稱：

銀行代號：　　電子信箱：

填表部門：　　填表人：　　聯絡電話：

單位：千元　　幣別：

區別	時間帶		計提率(1)	個別淨部位		加權部位		同一時間帶		同一區		跨區搭配部位		
	息票利率3%（含）以上	息票利率低於3%		長部位 (2)	短部位 (3)	長部位 (1)*(2)	短部位 (1)*(3)	搭配部位	非搭配部位	搭配部位	非搭配部位	第一及第二區	第二及第三區	第一及第三區
第一區	1個月以內	1個月以內	0.00%			0	0							
	超過1個月而在3個月以內	超過1個月而在3個月以內	0.20%			0	0							
	超過3個月而在6個月以內	超過3個月而在6個月以內	0.40%			0	0							
	超過6個月而在12個月以內	超過6個月而在12個月以內	0.70%			0	0							
第二區	超過1年而在2年以內	超過1年而在1.9年以內	1.25%			0	0							
	超過2年而在3年以內	超過1.9年而在2.8年以內	1.75%			0	0							
	超過3年而在4年以內	超過2.8年而在3.6年以內	2.25%			0	0							
第三區	超過4年而在5年以內	超過3.6年而在4.3年以內	2.75%			0	0							
	超過5年而在7年以內	超過4.3年而在5.7年以內	3.25%			0	0							
	超過7年而在10年以內	超過5.7年而在7.3年以內	3.75%			0	0							
	超過10年而在15年以內	超過7.3年而在9.3年以內	4.50%			0	0							
	超過15年而在20年以內	超過9.3年而在10.6年以內	5.25%			0	0							
	20年以上	超過10.6年而在12年以內	6.00%			0	0							
		超過12年而在20年以內	8.00%			0	0							
		20年以上	12.50%			0	0							
合計				0	0	0	0							

註：1. 灰色區域無須填報。

2.若有任何填報疑問，請電洽本處金融穩定評估科吳專員(02-2357-1468)。