

【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：

填表部門：

填表人：

電子信箱：

聯絡電話：

單位：千元 幣別：NTD

| 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% | | | | | | | | | | | |
| | 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% | | | | | | | | | | | |
| | 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% | | | | | | | | | | | |
| | 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% | | | | | | | | | | | |
| 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% | | | | | | | | | | | |
| | 超過2年而在3年以內 | 超過1.9年而在2.8年以內 | 1.75% | | | | | | | | | | | |
| | 超過3年而在4年以內 | 超過2.8年而在3.6年以內 | 2.25% | | | | | | | | | | | |
| 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% | | | | | | | | | | | |
| | 超過5年而在7年以內 | 超過4.3年而在5.7年以內 | 3.25% | | | | | | | | | | | |
| | 超過7年而在10年以內 | 超過5.7年而在7.3年以內 | 3.75% | | | | | | | | | | | |
| | 超過10年而在15年以內 | 超過7.3年而在9.3年以內 | 4.50% | | | | | | | | | | | |
| | 超過15年而在20年以內 | 超過9.3年而在10.6年以內 | 5.25% | | | | | | | | | | | |
| | 20年以上 | 超過10.6年而在12年以內 | 6.00% | | | | | | | | | | | |
| | | 超過12年而在20年以內 | 8.00% | | | | | | | | | | | |
| | 20年以上 | 12.50% | | | | | | | | | | | | |
| 合計 | | | | | | | | | | | | | | |

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黃副科長淑君(02-2357-1464)、王朝永(02-2357-1463)。