

利率風險報表

報告截止日期(日/月/年)

--

信用機構名稱
(倘適用時，亦包括附屬機構)

--

申報日期
(日/月/年)

--

除非澳門金融管理局另有指示，本報表內的資料須於三月、六月、九月及十二月的最後一天起計的三十日內交回澳門金融管理局。

- 註：
- (1) 本報表應根據澳門金融管理局發出的填報指示而填報。
 - (2) 此報表的電子版表格內含計算程式，信用機構在使用相容的電腦軟件來填報時只須在指定的方格內填寫。
 - (3) 受綜合監管的信用機構應同時提交另一份以合併基礎計算的報表，即包括報告機構的所有附屬機構的風險。

在澳門金融管理局有需要時可以聯絡的相關負責人員的姓名及電話號碼：

責任人姓名

電話號碼

本報表的填報貨幣

	(a)	(b)
1.	<u>MOP</u>	<u>澳門元</u>
2.	<u>HKD</u>	<u>港幣</u>
3.	<u>USD</u>	<u>美元</u>
4.	<u> </u>	<u> </u>
5.	<u> </u>	<u> </u>
6.	<u> </u>	<u> </u>
7.	<u> </u>	<u> </u>
8.	<u> </u>	<u> </u>
9.	<u> </u>	<u> </u>
10.	<u> </u>	<u> </u>

- Note: (1) 澳門元、港幣、美元必須填報。
- (2) 佔銀行賬資產或負債5%以上的貨幣必須填報。
- (3) 在(a)欄填上貨幣代號後，在(b)欄會自動顯示該貨幣的全稱，在本報表內將會以貨幣代號來標識該貨幣。
- (4) 如須填報的貨幣數量超過10種或有關貨幣並非在下表之內，請聯絡澳門金融管理局以作跟進。

貨幣表

AUD	澳大利亞元
CAD	加拿大元
CHF	瑞士法郎
CNY	人民幣
DKK	丹麥克朗
EUR	歐羅
GBP	英鎊
IDR	印尼盾
JPY	日圓
KRW	韓圓
MYR	馬來西亞幣
NOK	挪威克朗
NZD	新西蘭元
PHP	菲律賓披索
SEK	瑞典克朗
SGD	新加坡元
THB	泰銖
TWD	台幣

第一部份(a)：銀行賬資產以利率種類分類

報告機構名稱： -
日期 (日/月/年): -

1. 幣別： MOP
(仟元)

項目	時段	利率敏感資產			總額 (d)	檢查
		固定利率 (a)	浮動利率 (b)	其他利率 (c)		
1	少於1日	-	-	-	-	
2	>1 至 <= 7 日	-	-	-	-	
3	>7 日至 <= 1 個月	-	-	-	-	
4	>1 至 <= 3 個月	-	-	-	-	
5	>3 至 <= 6 個月	-	-	-	-	
6	>6 個月至 <=1 年	-	-	-	-	
7	>1 至 <=2 年	-	-	-	-	
8	>2 至 <=3 年	-	-	-	-	
9	>3 至 <=4 年	-	-	-	-	
10	>4 至 <=5 年	-	-	-	-	
11	>5 至 <=7 年	-	-	-	-	
12	>7 至 <=10 年	-	-	-	-	
13	>10 至 <=15 年	-	-	-	-	
14	>15 至 <=20 年	-	-	-	-	
15	超過 20 年	-	-	-	-	
16	銀行賬的利率敏感資產總額 (1(d) - 15(d)之總和)				-	
17	銀行賬的非利率敏感資產總額				-	
18	銀行賬的資產總額 (16(d) + 17(d))				-	

第一部份(a)：銀行賬資產以利率種類分類

報告機構名稱：

-

日期 (日/月/年):

-

2.

幣別：

HKD

(澳門元仟元等值)

項目	時段	利率敏感資產			總額 (d)	檢查
		固定利率 (a)	浮動利率 (b)	其他利率 (c)		
1	少於1日	-	-	-	-	
2	>1 至 <= 7 日	-	-	-	-	
3	>7 日至 <= 1 個月	-	-	-	-	
4	>1 至 <= 3 個月	-	-	-	-	
5	>3 至 <= 6 個月	-	-	-	-	
6	>6 個月至 <=1 年	-	-	-	-	
7	>1 至 <=2 年	-	-	-	-	
8	>2 至 <=3 年	-	-	-	-	
9	>3 至 <=4 年	-	-	-	-	
10	>4 至 <=5 年	-	-	-	-	
11	>5 至 <=7 年	-	-	-	-	
12	>7 至 <=10 年	-	-	-	-	
13	>10 至 <=15 年	-	-	-	-	
14	>15 至 <=20 年	-	-	-	-	
15	超過 20 年	-	-	-	-	
16	銀行賬的利率敏感資產總額 (1(d) - 15(d)之總和)				-	
17	銀行賬的非利率敏感資產總額				-	
18	銀行賬的資產總額 (16(d) + 17(d))				-	

第一部份(a)：銀行賬資產以利率種類分類

報告機構名稱：_____ -

日期 (日/月/年)：_____ -

3.

幣別：

USD

(澳門元仟元等值)

項目	時段	利率敏感資產			總額 (d)	檢查
		固定利率 (a)	浮動利率 (b)	其他利率 (c)		
1	少於1日	-	-	-	-	
2	>1 至 ≤ 7 日	-	-	-	-	
3	>7 日至 ≤ 1 個月	-	-	-	-	
4	>1 至 ≤ 3 個月	-	-	-	-	
5	>3 至 ≤ 6 個月	-	-	-	-	
6	>6 個月至 ≤ 1 年	-	-	-	-	
7	>1 至 ≤ 2 年	-	-	-	-	
8	>2 至 ≤ 3 年	-	-	-	-	
9	>3 至 ≤ 4 年	-	-	-	-	
10	>4 至 ≤ 5 年	-	-	-	-	
11	>5 至 ≤ 7 年	-	-	-	-	
12	>7 至 ≤ 10 年	-	-	-	-	
13	>10 至 ≤ 15 年	-	-	-	-	
14	>15 至 ≤ 20 年	-	-	-	-	
15	超過 20 年	-	-	-	-	
16	銀行賬的利率敏感資產總額 (1(d) - 15(d)之總和)				-	
17	銀行賬的非利率敏感資產總額				-	
18	銀行賬的資產總額 (16(d) + 17(d))				-	

第一部份(a)：銀行賬資產以利率種類分類

報告機構名稱：

-

日期 (日/月/年)：

-

4.

幣別：

-

(澳門元仟元等值)

項目	時段	利率敏感資產			總額 (d)	檢查
		固定利率 (a)	浮動利率 (b)	其他利率 (c)		
1	少於1日	-	-	-	-	
2	>1 至 ≤ 7 日	-	-	-	-	
3	>7 日至 ≤ 1 個月	-	-	-	-	
4	>1 至 ≤ 3 個月	-	-	-	-	
5	>3 至 ≤ 6 個月	-	-	-	-	
6	>6 個月至 ≤ 1 年	-	-	-	-	
7	>1 至 ≤ 2 年	-	-	-	-	
8	>2 至 ≤ 3 年	-	-	-	-	
9	>3 至 ≤ 4 年	-	-	-	-	
10	>4 至 ≤ 5 年	-	-	-	-	
11	>5 至 ≤ 7 年	-	-	-	-	
12	>7 至 ≤ 10 年	-	-	-	-	
13	>10 至 ≤ 15 年	-	-	-	-	
14	>15 至 ≤ 20 年	-	-	-	-	
15	超過 20 年	-	-	-	-	
16	銀行賬的利率敏感資產總額 (1(d) - 15(d)之總和)				-	
17	銀行賬的非利率敏感資產總額				-	
18	銀行賬的資產總額 (16(d) + 17(d))				-	

第一部份(b)：銀行賬資產以性質分類

報告機構名稱： _____
 日期 (日/月/年): _____

1. 幣別： _____ MOP
 (仟元)

項目	時段	利率敏感資產					總額 (f)	檢查
		銀行同業拆放 (a)	貸款 (b)	個人房屋貸款 (c)	投資 (d)	其他資產 (e)		
1	少於1日	-	-	-	-	-	-	
2	>1 至 <= 7 日	-	-	-	-	-	-	
3	>7 日至 <= 1 個月	-	-	-	-	-	-	
4	>1 至 <= 3 個月	-	-	-	-	-	-	
5	>3 至 <= 6 個月	-	-	-	-	-	-	
6	>6 個月至 <=1 年	-	-	-	-	-	-	
7	>1 至 <=2 年	-	-	-	-	-	-	
8	>2 至 <=3 年	-	-	-	-	-	-	
9	>3 至 <=4 年	-	-	-	-	-	-	
10	>4 至 <=5 年	-	-	-	-	-	-	
11	>5 至 <=7 年	-	-	-	-	-	-	
12	>7 至 <=10 年	-	-	-	-	-	-	
13	>10 至 <=15 年	-	-	-	-	-	-	
14	>15 至 <=20 年	-	-	-	-	-	-	
15	超過 20 年	-	-	-	-	-	-	
16	銀行賬的利率敏感資產總額 (1(d) - 15(d)之總和)						-	
17	銀行賬的非利率敏感資產總額						-	
18	銀行賬的資產總額 (16(d) + 17(d))						-	

第一部份(b)：銀行賬資產以性質分類

報告機構名稱： _____ -
 日期(日/月/年): _____ -

2. 幣別： _____ HKD
 (澳門元千元等值)

項目	時段	利率敏感資產					總額 (f)	檢查
		銀行同業拆放 (a)	貸款 (b)	個人房屋貸款 (c)	投資 (d)	其他資產 (e)		
1	少於1日	-	-	-	-	-	-	
2	>1 至 <= 7 日	-	-	-	-	-	-	
3	>7 日至 <= 1 個月	-	-	-	-	-	-	
4	>1 至 <= 3 個月	-	-	-	-	-	-	
5	>3 至 <= 6 個月	-	-	-	-	-	-	
6	>6 個月至 <=1 年	-	-	-	-	-	-	
7	>1 至 <=2 年	-	-	-	-	-	-	
8	>2 至 <=3 年	-	-	-	-	-	-	
9	>3 至 <=4 年	-	-	-	-	-	-	
10	>4 至 <=5 年	-	-	-	-	-	-	
11	>5 至 <=7 年	-	-	-	-	-	-	
12	>7 至 <=10 年	-	-	-	-	-	-	
13	>10 至 <=15 年	-	-	-	-	-	-	
14	>15 至 <=20 年	-	-	-	-	-	-	
15	超過 20 年	-	-	-	-	-	-	
16	銀行賬的利率敏感資產總額 (1(d) - 15(d)之總和)						-	
17	銀行賬的非利率敏感資產總額						-	
18	銀行賬的資產總額 (16(d) + 17(d))						-	

第一部份(b)：銀行賬資產以性質分類

報告機構名稱： _____
日期 (日/月/年)： _____

3. 幣別： USD
(澳門元仟元等值)

項目	時段	利率敏感資產					總額 (f)	檢查
		銀行同業拆放 (a)	貸款 (b)	個人房屋貸款 (c)	投資 (d)	其他資產 (e)		
1	少於1日	-	-	-	-	-	-	
2	>1 至 <= 7 日	-	-	-	-	-	-	
3	>7 日至 <= 1 個月	-	-	-	-	-	-	
4	>1 至 <= 3 個月	-	-	-	-	-	-	
5	>3 至 <= 6 個月	-	-	-	-	-	-	
6	>6 個月至 <=1 年	-	-	-	-	-	-	
7	>1 至 <=2 年	-	-	-	-	-	-	
8	>2 至 <=3 年	-	-	-	-	-	-	
9	>3 至 <=4 年	-	-	-	-	-	-	
10	>4 至 <=5 年	-	-	-	-	-	-	
11	>5 至 <=7 年	-	-	-	-	-	-	
12	>7 至 <=10 年	-	-	-	-	-	-	
13	>10 至 <=15 年	-	-	-	-	-	-	
14	>15 至 <=20 年	-	-	-	-	-	-	
15	超過 20 年	-	-	-	-	-	-	
16	銀行賬的利率敏感資產總額 (1(d) - 15(d)之總和)						-	
17	銀行賬的非利率敏感資產總額						-	
18	銀行賬的資產總額 (16(d) + 17(d))						-	

第一部份(b)：銀行賬資產以性質分類

報告機構名稱： _____
 日期 (日/月/年)： _____

4. 幣別： _____
 (澳門元千元等值)

項目	時段	利率敏感資產					總額 (f)	檢查
		銀行同業拆放 (a)	貸款 (b)	個人房屋貸款 (c)	投資 (d)	其他資產 (e)		
1	少於1日	-	-	-	-	-	-	
2	>1 至 ≤ 7 日	-	-	-	-	-	-	
3	>7 日至 ≤ 1 個月	-	-	-	-	-	-	
4	>1 至 ≤ 3 個月	-	-	-	-	-	-	
5	>3 至 ≤ 6 個月	-	-	-	-	-	-	
6	>6 個月至 ≤ 1 年	-	-	-	-	-	-	
7	>1 至 ≤ 2 年	-	-	-	-	-	-	
8	>2 至 ≤ 3 年	-	-	-	-	-	-	
9	>3 至 ≤ 4 年	-	-	-	-	-	-	
10	>4 至 ≤ 5 年	-	-	-	-	-	-	
11	>5 至 ≤ 7 年	-	-	-	-	-	-	
12	>7 至 ≤ 10 年	-	-	-	-	-	-	
13	>10 至 ≤ 15 年	-	-	-	-	-	-	
14	>15 至 ≤ 20 年	-	-	-	-	-	-	
15	超過 20 年	-	-	-	-	-	-	
16	銀行賬的利率敏感資產總額 (1(d) - 15(d)之總和)						-	
17	銀行賬的非利率敏感資產總額						-	
18	銀行賬的資產總額 (16(d) + 17(d))						-	

第二部份(a)：銀行賬負債以利率種類分類

報告機構名稱： _____ -
 日期 (日/月/年)： _____ -

1. 幣別： _____ MOP
 (仟元)

項目	時段	利率敏感負債			總額 (d)	檢查
		固定利率 (a)	浮動利率 (b)	其他利率 (c)		
1	少於1日	-	-	-	-	
2	>1 至 ≤ 7 日	-	-	-	-	
3	>7 日至 ≤ 1 個月	-	-	-	-	
4	>1 至 ≤ 3 個月	-	-	-	-	
5	>3 至 ≤ 6 個月	-	-	-	-	
6	>6 個月至 ≤ 1 年	-	-	-	-	
7	>1 至 ≤ 2 年	-	-	-	-	
8	>2 至 ≤ 3 年	-	-	-	-	
9	>3 至 ≤ 4 年	-	-	-	-	
10	>4 至 ≤ 5 年	-	-	-	-	
11	>5 至 ≤ 7 年	-	-	-	-	
12	>7 至 ≤ 10 年	-	-	-	-	
13	>10 至 ≤ 15 年	-	-	-	-	
14	>15 至 ≤ 20 年	-	-	-	-	
15	超過 20 年	-	-	-	-	
16	銀行賬的利率敏感負債總額 (1(d) - 15(d)之總和)				-	
17	銀行賬的非利率敏感負債總額				-	
18	銀行賬的負債總額 (16(d) + 17(d))				-	

第二部份(a)：銀行賬負債以利率種類分類

報告機構名稱： _____ -
 日期(日/月/年)： _____ -

2. 幣別： _____ HKD
 (澳門元千元等值)

項目	時段	利率敏感負債			總額 (d)	檢查
		固定利率 (a)	浮動利率 (b)	其他利率 (c)		
1	少於1日	-	-	-	-	
2	>1 至 ≤ 7 日	-	-	-	-	
3	>7 日至 ≤ 1 個月	-	-	-	-	
4	>1 至 ≤ 3 個月	-	-	-	-	
5	>3 至 ≤ 6 個月	-	-	-	-	
6	>6 個月至 ≤ 1 年	-	-	-	-	
7	>1 至 ≤ 2 年	-	-	-	-	
8	>2 至 ≤ 3 年	-	-	-	-	
9	>3 至 ≤ 4 年	-	-	-	-	
10	>4 至 ≤ 5 年	-	-	-	-	
11	>5 至 ≤ 7 年	-	-	-	-	
12	>7 至 ≤ 10 年	-	-	-	-	
13	>10 至 ≤ 15 年	-	-	-	-	
14	>15 至 ≤ 20 年	-	-	-	-	
15	超過 20 年	-	-	-	-	
16	銀行賬的利率敏感負債總額 (1(d) - 15(d)之總和)				-	
17	銀行賬的非利率敏感負債總額				-	
18	銀行賬的負債總額 (16(d) + 17(d))				-	

第二部份(a)：銀行賬負債以利率種類分類

報告機構名稱： _____ -
 日期(日/月/年)： _____ -

3. 幣別： _____ USD
 (澳門元仟元等值)

項目	時段	利率敏感負債			總額 (d)	檢查
		固定利率 (a)	浮動利率 (b)	其他利率 (c)		
1	少於1日	-	-	-	-	
2	>1 至 ≤ 7 日	-	-	-	-	
3	>7 日至 ≤ 1 個月	-	-	-	-	
4	>1 至 ≤ 3 個月	-	-	-	-	
5	>3 至 ≤ 6 個月	-	-	-	-	
6	>6 個月至 ≤ 1 年	-	-	-	-	
7	>1 至 ≤ 2 年	-	-	-	-	
8	>2 至 ≤ 3 年	-	-	-	-	
9	>3 至 ≤ 4 年	-	-	-	-	
10	>4 至 ≤ 5 年	-	-	-	-	
11	>5 至 ≤ 7 年	-	-	-	-	
12	>7 至 ≤ 10 年	-	-	-	-	
13	>10 至 ≤ 15 年	-	-	-	-	
14	>15 至 ≤ 20 年	-	-	-	-	
15	超過 20 年	-	-	-	-	
16	銀行賬的利率敏感負債總額 (1(d) - 15(d)之總和)				-	
17	銀行賬的非利率敏感負債總額				-	
18	銀行賬的負債總額 (16(d) + 17(d))				-	

第二部份(a)：銀行賬負債以利率種類分類

報告機構名稱： _____ -

日期(日/月/年)： _____ -

4. 幣別： _____ -
(澳門元千元等值)

項目	時段	利率敏感負債			總額 (d)	檢查
		固定利率 (a)	浮動利率 (b)	其他利率 (c)		
1	少於1日	-	-	-	-	
2	>1 至 <= 7 日	-	-	-	-	
3	>7 日至 <= 1 個月	-	-	-	-	
4	>1 至 <= 3 個月	-	-	-	-	
5	>3 至 <= 6 個月	-	-	-	-	
6	>6 個月至 <= 1 年	-	-	-	-	
7	>1 至 <= 2 年	-	-	-	-	
8	>2 至 <= 3 年	-	-	-	-	
9	>3 至 <= 4 年	-	-	-	-	
10	>4 至 <= 5 年	-	-	-	-	
11	>5 至 <= 7 年	-	-	-	-	
12	>7 至 <= 10 年	-	-	-	-	
13	>10 至 <= 15 年	-	-	-	-	
14	>15 至 <= 20 年	-	-	-	-	
15	超過 20 年	-	-	-	-	
16	銀行賬的利率敏感負債總額 (1(d) - 15(d)之總和)				-	
17	銀行賬的非利率敏感負債總額				-	
18	銀行賬的負債總額 (16(d) + 17(d))				-	

第二部份(b)：銀行賬負債以性質分類

報告機構名稱： _____ -
 日期 (日/月/年)： _____ -

1. 幣別： _____ MOP
 (仟元)

項目	時段	利率敏感負債			總額 (d)	檢查
		銀行同業存放 (a)	存款 (b)	其他負債 (c)		
1	少於1日	-	-	-	-	
2	>1 至 <= 7 日	-	-	-	-	
3	>7 日至 <= 1 個月	-	-	-	-	
4	>1 至 <= 3 個月	-	-	-	-	
5	>3 至 <= 6 個月	-	-	-	-	
6	>6 個月至 <=1 年	-	-	-	-	
7	>1 至 <=2 年	-	-	-	-	
8	>2 至 <=3 年	-	-	-	-	
9	>3 至 <=4 年	-	-	-	-	
10	>4 至 <=5 年	-	-	-	-	
11	>5 至 <=7 年	-	-	-	-	
12	>7 至 <=10 年	-	-	-	-	
13	>10 至 <=15 年	-	-	-	-	
14	>15 至 <=20 年	-	-	-	-	
15	超過 20 年	-	-	-	-	
16	銀行賬的利率敏感負債總額 (1(d) - 15(d)之總和)				-	
17	銀行賬的非利率敏感負債總額				-	
18	銀行賬的負債總額 (16(d) + 17(d))				-	

第二部份(b)：銀行賬負債以性質分類

報告機構名稱： _____
 日期 (日/月/年)： _____

2. 幣別： _____ HKD
 (澳門元仟元等值)

項目	時段	利率敏感負債			總額 (d)	檢查
		銀行同業存放 (a)	存款 (b)	其他負債 (c)		
1	少於1日	-	-	-	-	
2	>1 至 <= 7 日	-	-	-	-	
3	>7 日至 <= 1 個月	-	-	-	-	
4	>1 至 <= 3 個月	-	-	-	-	
5	>3 至 <= 6 個月	-	-	-	-	
6	>6 個月至 <=1 年	-	-	-	-	
7	>1 至 <=2 年	-	-	-	-	
8	>2 至 <=3 年	-	-	-	-	
9	>3 至 <=4 年	-	-	-	-	
10	>4 至 <=5 年	-	-	-	-	
11	>5 至 <=7 年	-	-	-	-	
12	>7 至 <=10 年	-	-	-	-	
13	>10 至 <=15 年	-	-	-	-	
14	>15 至 <=20 年	-	-	-	-	
15	超過 20 年	-	-	-	-	
16	銀行賬的利率敏感負債總額 (1(d) - 15(d)之總和)				-	
17	銀行賬的非利率敏感負債總額				-	
18	銀行賬的負債總額 (16(d) + 17(d))				-	

第二部份(b)：銀行賬負債以性質分類

報告機構名稱： _____ -
 日期(日/月/年)： _____ -

3. 幣別： _____ USD
 (澳門元仟元等值)

項目	時段	利率敏感負債			總額 (d)	檢查
		銀行同業存放 (a)	存款 (b)	其他負債 (c)		
1	少於1日	-	-	-	-	
2	>1 至 ≤ 7 日	-	-	-	-	
3	>7 日至 ≤ 1 個月	-	-	-	-	
4	>1 至 ≤ 3 個月	-	-	-	-	
5	>3 至 ≤ 6 個月	-	-	-	-	
6	>6 個月至 ≤ 1 年	-	-	-	-	
7	>1 至 ≤ 2 年	-	-	-	-	
8	>2 至 ≤ 3 年	-	-	-	-	
9	>3 至 ≤ 4 年	-	-	-	-	
10	>4 至 ≤ 5 年	-	-	-	-	
11	>5 至 ≤ 7 年	-	-	-	-	
12	>7 至 ≤ 10 年	-	-	-	-	
13	>10 至 ≤ 15 年	-	-	-	-	
14	>15 至 ≤ 20 年	-	-	-	-	
15	超過 20 年	-	-	-	-	
16	銀行賬的利率敏感負債總額 (1(d) - 15(d)之總和)				-	
17	銀行賬的非利率敏感負債總額				-	
18	銀行賬的負債總額 (16(d) + 17(d))				-	

第二部份(b)：銀行賬負債以性質分類

報告機構名稱： _____ -
 日期(日/月/年)： _____ -

4. 幣別： _____ -
 (澳門元千元等值)

項目	時段	利率敏感負債			總額 (d)	檢查
		銀行同業存放 (a)	存款 (b)	其他負債 (c)		
1	少於1日	-	-	-	-	
2	>1 至 ≤ 7 日	-	-	-	-	
3	>7 日至 ≤ 1 個月	-	-	-	-	
4	>1 至 ≤ 3 個月	-	-	-	-	
5	>3 至 ≤ 6 個月	-	-	-	-	
6	>6 個月至 ≤ 1 年	-	-	-	-	
7	>1 至 ≤ 2 年	-	-	-	-	
8	>2 至 ≤ 3 年	-	-	-	-	
9	>3 至 ≤ 4 年	-	-	-	-	
10	>4 至 ≤ 5 年	-	-	-	-	
11	>5 至 ≤ 7 年	-	-	-	-	
12	>7 至 ≤ 10 年	-	-	-	-	
13	>10 至 ≤ 15 年	-	-	-	-	
14	>15 至 ≤ 20 年	-	-	-	-	
15	超過 20 年	-	-	-	-	
16	銀行賬的利率敏感負債總額 (1(d) - 15(d)之總和)				-	
17	銀行賬的非利率敏感負債總額				-	
18	銀行賬的負債總額 (16(d) + 17(d))				-	

第三部份：銀行賬表外項目－長盤

報告機構名稱： -

日期 (日/月/年): -

1. 幣別: MOP
(仟元)

項目	時段	長盤			總額 (d)
		外匯合約 (a)	利率合約 (b)	其他合約 (c)	
1	少於1日	-	-	-	-
2	>1 至 <= 7 日	-	-	-	-
3	>7 日至 <= 1 個月	-	-	-	-
4	>1 至 <= 3 個月	-	-	-	-
5	>3 至 <= 6 個月	-	-	-	-
6	>6 個月至 <= 1 年	-	-	-	-
7	>1 至 <= 2 年	-	-	-	-
8	>2 至 <= 3 年	-	-	-	-
9	>3 至 <= 4 年	-	-	-	-
10	>4 至 <= 5 年	-	-	-	-
11	>5 至 <= 7 年	-	-	-	-
12	>7 至 <= 10 年	-	-	-	-
13	>10 至 <= 15 年	-	-	-	-
14	>15 至 <= 20 年	-	-	-	-
15	超過 20 年	-	-	-	-
16	銀行賬長盤總額 (1(d) - 15(d)之總和)				-

第三部份：銀行賬表外項目－長盤

報告機構名稱： _____ -
 日期 (日/月/年): _____ -

2. 幣別: _____ HKD
 (澳門元仟元等值)

項目	時段	長盤			總額 (d)
		外匯合約 (a)	利率合約 (b)	其他合約 (c)	
1	少於1日	-	-	-	-
2	>1 至 <= 7 日	-	-	-	-
3	>7 日至 <= 1 個月	-	-	-	-
4	>1 至 <= 3 個月	-	-	-	-
5	>3 至 <= 6 個月	-	-	-	-
6	>6 個月至 <=1 年	-	-	-	-
7	>1 至 <=2 年	-	-	-	-
8	>2 至 <=3 年	-	-	-	-
9	>3 至 <=4 年	-	-	-	-
10	>4 至 <=5 年	-	-	-	-
11	>5 至 <=7 年	-	-	-	-
12	>7 至 <=10 年	-	-	-	-
13	>10 至 <=15 年	-	-	-	-
14	>15 至 <=20 年	-	-	-	-
15	超過 20 年	-	-	-	-
16	銀行賬長盤總額 (1(d) - 15(d)之總和)				-

第三部份：銀行賬表外項目－長盤

報告機構名稱： _____ -
 日期(日/月/年): _____ -

3. 幣別: _____ USD
 (澳門元千元等值)

項目	時段	長盤			總額 (d)
		外匯合約 (a)	利率合約 (b)	其他合約 (c)	
1	少於1日	-	-	-	-
2	>1 至 ≤ 7 日	-	-	-	-
3	>7 日至 ≤ 1 個月	-	-	-	-
4	>1 至 ≤ 3 個月	-	-	-	-
5	>3 至 ≤ 6 個月	-	-	-	-
6	>6 個月至 ≤ 1 年	-	-	-	-
7	>1 至 ≤ 2 年	-	-	-	-
8	>2 至 ≤ 3 年	-	-	-	-
9	>3 至 ≤ 4 年	-	-	-	-
10	>4 至 ≤ 5 年	-	-	-	-
11	>5 至 ≤ 7 年	-	-	-	-
12	>7 至 ≤ 10 年	-	-	-	-
13	>10 至 ≤ 15 年	-	-	-	-
14	>15 至 ≤ 20 年	-	-	-	-
15	超過 20 年	-	-	-	-
16	銀行賬長盤總額 (1(d) - 15(d)之總和)				-

第三部份：銀行賬表外項目－長盤

報告機構名稱： _____ -
 日期 (日/月/年): _____ -

4. 幣別: _____ -
 (澳門元千元等值)

項目	時段	長盤			總額 (d)
		外匯合約 (a)	利率合約 (b)	其他合約 (c)	
1	少於1日	-	-	-	-
2	>1 至 <= 7 日	-	-	-	-
3	>7 日至 <= 1 個月	-	-	-	-
4	>1 至 <= 3 個月	-	-	-	-
5	>3 至 <= 6 個月	-	-	-	-
6	>6 個月至 <=1 年	-	-	-	-
7	>1 至 <=2 年	-	-	-	-
8	>2 至 <=3 年	-	-	-	-
9	>3 至 <=4 年	-	-	-	-
10	>4 至 <=5 年	-	-	-	-
11	>5 至 <=7 年	-	-	-	-
12	>7 至 <=10 年	-	-	-	-
13	>10 至 <=15 年	-	-	-	-
14	>15 至 <=20 年	-	-	-	-
15	超過 20 年	-	-	-	-
16	銀行賬長盤總額 (1(d) - 15(d)之總和)				-

第四部份：銀行賬表外項目－短盤

報告機構名稱： _____ -
 日期 (日/月/年): _____ -

1. 幣別: _____ MOP
 (仟元)

項目	時段	短盤			總額 (d)
		外匯合約 (a)	利率合約 (b)	其他合約 (c)	
1	少於1日	-	-	-	-
2	>1 至 <= 7 日	-	-	-	-
3	>7 日至 <= 1 個月	-	-	-	-
4	>1 至 <= 3 個月	-	-	-	-
5	>3 至 <= 6 個月	-	-	-	-
6	>6 個月至 <=1 年	-	-	-	-
7	>1 至 <=2 年	-	-	-	-
8	>2 至 <=3 年	-	-	-	-
9	>3 至 <=4 年	-	-	-	-
10	>4 至 <=5 年	-	-	-	-
11	>5 至 <=7 年	-	-	-	-
12	>7 至 <=10 年	-	-	-	-
13	>10 至 <=15 年	-	-	-	-
14	>15 至 <=20 年	-	-	-	-
15	超過 20 年	-	-	-	-
16	銀行賬短盤總額 (1(d) - 15(d)之總和)				-

第四部份：銀行賬表外項目－短盤

報告機構名稱： _____ -
 日期 (日/月/年): _____ -

2. 幣別: _____ HKD
 (澳門元仟元等值)

項目	時段	短盤			總額 (d)
		外匯合約 (a)	利率合約 (b)	其他合約 (c)	
1	少於1日	-	-	-	-
2	>1 至 <= 7 日	-	-	-	-
3	>7 日至 <= 1 個月	-	-	-	-
4	>1 至 <= 3 個月	-	-	-	-
5	>3 至 <= 6 個月	-	-	-	-
6	>6 個月至 <= 1 年	-	-	-	-
7	>1 至 <= 2 年	-	-	-	-
8	>2 至 <= 3 年	-	-	-	-
9	>3 至 <= 4 年	-	-	-	-
10	>4 至 <= 5 年	-	-	-	-
11	>5 至 <= 7 年	-	-	-	-
12	>7 至 <= 10 年	-	-	-	-
13	>10 至 <= 15 年	-	-	-	-
14	>15 至 <= 20 年	-	-	-	-
15	超過 20 年	-	-	-	-
16	銀行賬短盤總額 (1(d) - 15(d)之總和)				-

第四部份：銀行賬表外項目－短盤

報告機構名稱： _____ -
 日期(日/月/年): _____ -

3. 幣別: _____ USD
 (澳門元仟元等值)

項目	時段	短盤			總額 (d)
		外匯合約 (a)	利率合約 (b)	其他合約 (c)	
1	少於1日	-	-	-	-
2	>1 至 ≤ 7 日	-	-	-	-
3	>7 日至 ≤ 1 個月	-	-	-	-
4	>1 至 ≤ 3 個月	-	-	-	-
5	>3 至 ≤ 6 個月	-	-	-	-
6	>6 個月至 ≤ 1 年	-	-	-	-
7	>1 至 ≤ 2 年	-	-	-	-
8	>2 至 ≤ 3 年	-	-	-	-
9	>3 至 ≤ 4 年	-	-	-	-
10	>4 至 ≤ 5 年	-	-	-	-
11	>5 至 ≤ 7 年	-	-	-	-
12	>7 至 ≤ 10 年	-	-	-	-
13	>10 至 ≤ 15 年	-	-	-	-
14	>15 至 ≤ 20 年	-	-	-	-
15	超過 20 年	-	-	-	-
16	銀行賬短盤總額 (1(d) - 15(d)之總和)				-

第四部份：銀行賬表外項目－短盤

報告機構名稱： _____ -
 日期 (日/月/年): _____ -

4. 幣別: _____ -
 (澳門元仟元等值)

項目	時段	短盤			總額 (d)
		外匯合約 (a)	利率合約 (b)	其他合約 (c)	
1	少於1日	-	-	-	-
2	>1 至 <= 7 日	-	-	-	-
3	>7 日至 <= 1 個月	-	-	-	-
4	>1 至 <= 3 個月	-	-	-	-
5	>3 至 <= 6 個月	-	-	-	-
6	>6 個月至 <=1 年	-	-	-	-
7	>1 至 <=2 年	-	-	-	-
8	>2 至 <=3 年	-	-	-	-
9	>3 至 <=4 年	-	-	-	-
10	>4 至 <=5 年	-	-	-	-
11	>5 至 <=7 年	-	-	-	-
12	>7 至 <=10 年	-	-	-	-
13	>10 至 <=15 年	-	-	-	-
14	>15 至 <=20 年	-	-	-	-
15	超過 20 年	-	-	-	-
16	銀行賬短盤總額 (1(d) - 15(d)之總和)				-

第五部份：200個基點波動的利率風險分析

報告機構：

-

日期 (日/月/年):

-

1.

幣別:

MOP

(仟元)

項目	時段	第一部份 長盤 (a)	第二部份 (短盤) (b)	第三部份 長盤 (c)	第四部份 (短盤) (d)	淨長盤/ (短盤)總額 (e)	權數	加權淨長盤/ (短盤) (f)
1	少於1日	-	-	-	-	-	0.00%	-
2	>1 至 ≤ 7 日	-	-	-	-	-	0.02%	-
3	>7 日至 ≤ 1 個月	-	-	-	-	-	0.10%	-
4	>1 至 ≤ 3 個月	-	-	-	-	-	0.32%	-
5	>3 至 ≤ 6 個月	-	-	-	-	-	0.72%	-
6	>6 個月至 ≤ 1 年	-	-	-	-	-	1.43%	-
7	>1 至 ≤ 2 年	-	-	-	-	-	2.77%	-
8	>2 至 ≤ 3 年	-	-	-	-	-	4.49%	-
9	>3 至 ≤ 4 年	-	-	-	-	-	6.14%	-
10	>4 至 ≤ 5 年	-	-	-	-	-	7.71%	-
11	>5 至 ≤ 7 年	-	-	-	-	-	10.15%	-
12	>7 至 ≤ 10 年	-	-	-	-	-	13.26%	-
13	>10 至 ≤ 15 年	-	-	-	-	-	17.84%	-
14	>15 至 ≤ 20 年	-	-	-	-	-	22.43%	-
15	超過 20 年	-	-	-	-	-	26.03%	-
16	此幣別之加權總額 (1(d) - 15(d)之總和)							-
17	其他幣別之加權總額							-
18	所有幣別之加權總額 (16(f)+17(f))							-
19	自有資金*							-
20	對經濟價值的影響以在自有資金中的比例表示* (18(f) as % of 19(f))							-

(* 有關項目只適用於住所在澳門之信用機構。)

報告機構：

日期 (日/月/年):

2. 幣別: HKD (澳門元/元等值)

[illegible]

報告機構：

日期 (日/月/年):

幣別:

USD

(澳門元仟元等值)

[illegible]

報告機構：

幣別:

(澳門元仟元等值)

[illegible]

填報申報表的方法

1. 信用機構的資產負債表項目，應以澳門元或等值澳門元，以下列準則填報在第一至第四部份的不同時段內：
 - (a) 所有對利率的變動敏感而又屬於銀行賬的資產、負債及資產負債表表外項目（包括所有利率衍生工具），應填報在一個由 15 個時段組成的到期表內。澳門元、港元、美元及每種佔銀行賬資產或負債 5% 以上的其他貨幣，應使用獨立的到期表，在第一至第四部份分別填寫。
 - (b) 資產負債表的表內項目應以賬面值填報。
 - (c) 第一部份(a)表及第二部份(a)表內「固定利率」一欄是供填報該些利率已固定至到期日的資產及負債。屬固定利率的工具，例如固定利率的定期貸款或存款，應根據其剩餘期限填報。
 - (d) 第一部份(a)表及第二部份(a)表內「浮動利率」一欄是供填報該些在最終到期日之前的下一個利率重訂日自動因應參考利率的變動而重訂利率的資產及負債。屬浮動利率的工具，例如浮動利率票據、浮動利率存款證及浮動利率貸款應根據直至到下一個利率重訂日的剩餘期限填報。在最後一個利率重訂日及最終到期日之間的一段期間，屬浮動利率的工具應根據其剩餘期限填報。
 - (e) 第一部份(a)表及第二部份(a)表內「其他利率」一欄是供填報該些既非固定利率亦非浮動利率的工具。這些工具包括沒有固定的利率重訂日的資產或負債，或該些利率不會因為參考利率變動而自動改變，但會因相關機構或交易對手的決定而改變的工具。屬其他利率的工具，例如個人房屋貸款或儲蓄存款，應以參考利率會在報告截止日期的翌日進行調整這項假設下，工具的利率可以被調整的最早期限填報。
 - (f) 第一部份(b)表及第二部份(b)表的資產及負債應遵循第一部份(a)表及第二部份(a)表中就固定利率、浮動利率及其他利率所設定的填報方法作填報。
 - (g) 非利率敏感資產指不帶利息的資產，例如物業、股權、固定資產。物業及固定資產應扣除折舊。非利率敏感負債指資本及儲備及其他不帶利息的負債，例如貸款撥備。
 - (h) 衍生工具應轉換為所涉工具的持倉，有關金額應為所涉工具的本金或名義金額。

- (i) 期貨及遠期合約，包括遠期利率協議（FRA），應被視作為一項長盤及一項短盤的組合，期貨或遠期利率協議的到期日，應為到該合約的交付日或行使日為止的剩餘期限，再加上〔如適用的話〕所涉工具的本身期限。例如，一項在五月份交付的三個月期的利率期貨長盤（在三月份訂立），應填報為一項有五個月剩餘期的長盤及一項有兩個月剩餘期的短盤。
- (j) 掉期合約應被視為兩項適當期限的名義持倉。例如，當一家信用機構在一項利率掉期合約中收取浮動利率的利息而支付固定利率的利息時，該利率掉期合約應被視為一項期限直至下次利率重訂日的浮動利率長盤及一項以掉期合約剩餘期限為期的固定利率短盤。跨貨幣掉期合約的兩項持倉應填報在所涉貨幣的到期表內。
- (k) 期權應以所涉工具的 delta 加權值或所涉工具的名義金額填報。

2. 第五部份的計算過程由五個步驟組成：

- (a) 第一步，是在每個時段內把所有長盤及短盤進行抵銷，使各時段內只餘下一項淨短盤或淨長盤。
- (b) 第二步，是把每個時段的淨長盤或淨短盤乘以相關的權數。該些權數的設定是基於如下的假設：利率在隨後的時間有 200 個基點的平行式波動，及持倉量的修正存續期間〔modified duration〕是按各時段的中間點及 5% 的收益率來計算。
- (c) 第三步，把所有時段的加權淨長盤及加權淨短盤抵銷加總，使每一種貨幣的銀行賬只餘下一項加權淨短盤或加權淨長盤。
- (d) 第四步，是把不同貨幣的淨加權長盤及淨加權短盤抵銷加總，計算全部銀行賬的加權總額。
- (e) 第五步只適用於在澳門註冊的信用機構，此步驟以信用機構全部銀行賬的加權總額與其自有資金作比較。