

(格式F)

利率敏感性資產負債分析表（新臺幣）

單位：新臺幣千元，%

項目	1至90天（含）	91至180天(含)	181天至1年(含)	1年以上	合計
利率敏感性資產	550,025,062	2,626,364	4,411,704	124,357,600	681,420,730
利率敏感性負債	686,937,733	11,962,755	351,398	12,840,000	712,091,886
利率敏感性缺口	(136,912,671)	(9,336,391)	4,060,306	111,517,600	(30,671,156)
淨值					31,387,697
利率敏感性資產與負債比率					95.69
利率敏感性缺口與淨值比率					(97.72)

說明：1、本表係指全行新臺幣之金額，且不包括或有資產及或有負債項目。

2、利率敏感性資產及負債係指其收益或成本受利率變動影響之生利資產及付息負債。

3、利率敏感性缺口＝利率敏感性資產－利率敏感性負債。

4、利率敏感性資產與負債比率＝利率敏感性資產÷利率敏感性負債（指新臺幣利率敏感性資產與利率敏感性負債）。

利率敏感性資產負債分析表（美金）

單位：美金千元，%

項目	1至90天（含）	91至180天(含)	181天至1年(含)	1年以上	合計
利率敏感性資產	431,497	2,950	-	2,839,991	3,274,438
利率敏感性負債	1,623,021	2,137	11,031	-	1,636,189
利率敏感性缺口	(1,191,524)	813	(11,031)	2,839,991	1,638,249
淨值					-
利率敏感性資產與負債比率					200.13
利率敏感性缺口與淨值比率					-

說明：1、本表係指全行美金之金額，且不包括或有資產及或有負債項目。

2、利率敏感性資產及負債係指其收益或成本受利率變動影響之生利資產及付息負債。

3、利率敏感性缺口＝利率敏感性資產－利率敏感性負債。

4、利率敏感性資產與負債比率＝利率敏感性資產÷利率敏感性負債（指美金利率敏感性資產與利率敏感性負債）。

(格式R)

主要外幣淨部位

單位：新臺幣千元

	108年6月30日				107年6月30日			
主要外幣淨部位 (市場風險)			原幣(千元)	折合新臺幣			原幣(千元)	折合新臺幣
	1	USD	1,844,587	57,285,492	1	USD	1,966,933	60,050,471
	2	EUR	49,047	1,731,910	2	EUR	148,701	5,286,661
	3	AUD	5,819	126,647	3	CNY	767,603	3,528,519
	4	CNY	3,837	17,335	4	JPY	472,980	130,353
	5	NZD	67	1,387	5	AUD	3,601	81,155

說明：1、主要外幣係折算為同一幣別後，部位金額較高之前五者。

2、主要外幣淨部位係各幣別淨部位之絕對值。