

(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	560,232,235	2,147,765	463,412	107,377,141	670,220,553
利率敏感性負債	655,824,887	10,853,837	22,218	12,840,000	679,540,942
利率敏感性缺口	(95,592,652)	(8,706,072)	441,194	94,537,141	(9,320,389)
淨值					31,784,611
利率敏感性資產與負債比率					98.63
利率敏感性缺口與淨值比率					(29.32)

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	1,157,031	6,158	30,951	2,233,684	3,427,824
利率敏感性負債	2,105,322	318,921	4,039	-	2,428,282
利率敏感性缺口	(948,291)	(312,763)	26,912	2,233,684	999,542
淨值					-
利率敏感性資產與負債比率					141.16
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12月31日				107年12月31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	958,503	28,743,591	1	USD	1,980,291	60,874,136
	2	AUD	369,404	7,757,367	2	EUR	32,018	1,128,324
	3	EUR	9,798	329,420	3	JPY	3,213,259	892,001
	4	CNY	3,716	15,976	4	AUD	3,619	78,457
	5	NZD	66	1,329	5	CNY	2,497	11,174

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。