

(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	532,367,209	5,052,570	8,881,830	99,852,017	646,153,626
利率敏感性負債	712,698,685	6,239,259	25,853	15,000,000	733,963,797
利率敏感性缺口	(180,331,476)	(1,186,689)	8,855,977	84,852,017	(87,810,171)
淨值					28,808,242
利率敏感性資產與負債比率					88.04
利率敏感性缺口與淨值比率					(304.81)

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	719,516	90,121	27,187	2,950,513	3,787,337
利率敏感性負債	650,493	82,507	126,409	—	859,409
利率敏感性缺口	69,023	7,614	(99,222)	2,950,513	2,927,928
淨值					—
利率敏感性資產與負債比率					440.69
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

	106 年 9 月 30 日				105 年 9 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	2,933,865	88,717,129	3,251,875	102,024,326
	2	CNY	808,968	3,691,726	1,338,756	6,286,263
	3	EUR	112,073	4,010,598	112,624	3,961,819
	4	JPY	208,876	56,355	4,953,488	1,535,581

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。