

(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	522,672,934	5,434,498	9,738,521	103,226,870	641,072,823
利率敏感性負債	693,750,053	7,762,695	148,050	15,000,000	716,660,798
利率敏感性缺口	(171,077,119)	(2,328,197)	9,590,471	88,226,870	(75,587,975)
淨值					28,791,671
利率敏感性資產與負債比率					89.45
利率敏感性缺口與淨值比率					(262.53)

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	395,144	9,008	-	3,053,361	3,457,513
利率敏感性負債	612,037	55,547	134,879	-	802,463
利率敏感性缺口	(216,893)	(46,539)	(134,879)	3,053,361	2,655,050
淨值					-
利率敏感性資產與負債比率					430.86
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12月31日				105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	2,661,585	78,939,957	1	USD	3,477,050	111,957,539
	2	EUR	111,280	3,942,627	2	CNY	1,339,007	6,184,741
	3	CNY	764,937	3,479,164	3	EUR	110,948	3,760,975
	4	JPY	100,666	26,485	4	JPY	4,915,127	1,359,033

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。