

(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	539,826,263	10,921,390	9,836,426	93,731,775	654,315,854
利率敏感性負債	709,431,498	6,211,597	210,194	15,000,000	730,853,289
利率敏感性缺口	(169,605,235)	4,709,793	9,626,232	78,731,775	(76,537,435)
淨值					27,810,498
利率敏感性資產與負債比率					89.53
利率敏感性缺口與淨值比率					(275.21)

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	285,666	15,649	22,211	2,187,440	2,510,966
利率敏感性負債	227,491	-	171	20	227,682
利率敏感性缺口	58,175	15,649	22,040	2,187,420	2,283,284
淨值					-
利率敏感性資產與負債比率					1,102.84
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

主要外幣淨部位 (市場風險)	105 年 3 月 31 日				104 年 3 月 31 日	
		原幣 (千元)		折合新臺幣	原幣(千元)	折合新臺幣
	1	USD	2,388,063	76,847,859	9.449	296
	2	CNY	1,361,323	6,779,118	95.8	484
	3	EUR	93,101	3,393,818	1	34
	4	JPY	2,103,103	602,749	1,100	287

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。