

(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	533,117,284	7,561,655	11,995,500	92,427,856	645,102,295
利率敏感性負債	720,349,874	6,443,722	79,356	15,000,000	741,872,952
利率敏感性缺口	(187,232,590)	1,117,933	11,916,144	77,427,856	(96,770,657)
淨值					28,442,244
利率敏感性資產與負債比率					86.96
利率敏感性缺口與淨值比率					(340.24)

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	413,543	3,567	74,262	2,801,803	3,293,175
利率敏感性負債	46,041	10,000	131,191	—	187,232
利率敏感性缺口	367,502	(6,433)	(56,929)	2,801,803	3,105,943
淨值					—
利率敏感性資產與負債比率					1,758.87
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

	105 年 6 月 30 日				104 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	3,151,247	101,731,701	9.649	298
	2	CNY	1,629,045	7,895,656	95.8	476
	3	EUR	100,303	3,595,477	1	35
	4	JPY	2,499,353	785,047	1,099	277

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。