

## 【附表二十三】

流動性覆蓋比率揭露表  
105年6月30日

單位：新臺幣千元

項目		105/6/30		105/3/31	
		未加權金額 <sup>1</sup>	加權後金額 <sup>2</sup>	未加權金額 <sup>1</sup>	加權後金額 <sup>2</sup>
高品質流動性資產					
1	高品質流動性資產總額	269,415,347	255,464,504	262,134,655	249,022,529
現金流出					
2	零售存款與小型企業存款	1,277,208	85,030	1,391,484	98,740
3	穩定存款	649,126	22,222	626,468	22,238
4	較不穩定存款	595,793	59,579	750,535	75,054
5	無擔保批發性資金	689,545,174	186,805,713	674,010,127	171,962,689
6	營運存款及於機構網路中合作銀行之存款	667,720,130	166,930,033	667,070,430	166,767,608
7	非營運存款	3,248,940	1,299,576	2,907,694	1,163,077
8	其他無擔保批發性資金	18,576,104	18,576,104	4,032,004	4,032,004
9	擔保融資交易	10,327,318	920,216	15,568,057	1,826,033
10	其他要求	148,419,344	21,805,727	152,247,404	20,661,551
11	衍生性商品交易現金流出	324,136	324,136	13,380	13,380
12	資產基礎商業本票、結構型投資工具、資產擔保證券或特殊目的機構等類似融資工具之資金流出	-	-	-	-
13	經承諾信用融資額度及流動性融資額度未動用餘額	121,993,523	18,818,234	127,792,611	19,712,343
14	其他約定現金流出	2,346,362	2,346,362	634,149	634,149
15	其他或有融資負債	23,755,323	316,995	23,807,264	301,679
16	現金流出總額	849,569,044	209,616,686	843,217,072	194,549,013
現金流入					
17	擔保借出交易	-	-	-	-
18	履約暴險之現金流入	12,295,950	11,413,022	7,814,894	6,898,324
19	其他現金流入	36,463,279	36,463,279	15,628,143	15,628,143
20	現金流入總額	48,759,229	47,876,301	23,443,037	22,526,467
流動性覆蓋比率			調整後金額		調整後金額
21	合格高品質流動性資產總額 <sup>3</sup>		255,464,504		249,022,529
22	淨現金流出總計 <sup>3</sup>		161,740,385		172,022,546
23	流動性覆蓋比率(%)		157.95		144.76

註1：未加權之現金流出與流入金額，係以帳上餘額計算為原則

註2：加權後高品質流動性資產金額，係指須適用相關折扣比率後之金額(未經第二層B級與第二層資產上限調整之金額)；加權後現金流出與流入金額係適用相關流失與流入係數後之金額。

註3：調整後合格高品質流動性資產總額，係適用折扣比率及第二層B級與第二層資產上限調整後之金額；調整後淨現金流出總計，係適用相關流失與流入係數及現金流入上限調整後之金額。