

【附表二十三】

流動性覆蓋比率揭露表
104年6月30日

單位：新臺幣千元

項目		104年6月30日		104年3月31日	
		未加權金額 ¹	加權後金額 ²	未加權金額 ¹	加權後金額 ²
高品質流動性資產					
1	高品質流動性資產總額	310,049,132	291,722,402	310,400,007	292,194,845
現金流出					
2	零售存款與小型企業存款	1,157,894	80,349	1,187,074	84,832
3	穩定存款	550,958	19,655	524,465	18,571
4	較不穩定存款	606,936	60,694	662,609	66,261
5	無擔保批發性資金	684,476,273	191,926,787	681,533,777	187,701,452
6	營運存款及於機構網路中合作銀行之存款	655,268,828	163,817,207	656,813,002	164,203,250
7	非營運存款	1,829,776	731,910	2,037,623	815,049
8	其他無擔保批發性資金	27,377,670	27,377,670	22,683,152	22,683,152
9	擔保融資交易	30,144,028	2,532,609	28,938,213	2,796,350
10	其他要求	125,682,512	16,897,404	117,676,448	16,201,099
11	衍生性商品交易現金流出	23,372	23,372	69,600	69,600
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	101,714,541	15,722,194	97,643,801	14,820,811
14	其他約定現金流出	883,007	883,007	1,088,387	1,088,387
15	其他或有融資負債	23,061,591	268,831	18,874,659	222,301
16	現金流出總額	841,460,707	211,437,149	829,335,512	206,783,733
現金流入					
17	擔保借出交易	-	-	-	-
18	履約暴險之現金流入	5,181,992	3,437,399	8,298,833	5,596,261
19	其他現金流入	36,828,424	36,828,424	16,257,549	16,257,549
20	現金流入總額	42,010,416	40,265,822	24,556,382	21,853,810
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 ³		291,722,402		292,194,845
22	淨現金流出總計 ³		171,171,326		184,929,922
23	流動性覆蓋比率(%)		170.43		158.00

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。