

【附表二十三】

流動性覆蓋比率揭露表
104年12月31日

單位：新臺幣千元

項目		104年12月31日		104年9月30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	303,505,809	286,649,865	300,500,724	282,853,569
現金流出					
2	零售存款與小型企業存款	1,298,972	92,238	1,150,747	76,735
3	穩定存款	580,792	20,420	596,432	21,304
4	較不穩定存款	718,180	71,818	554,315	55,431
5	無擔保批發性資金	674,245,843	183,561,549	679,613,740	185,871,573
6	營運存款及於機構網路中合作銀行之存款	652,386,853	163,096,713	656,465,687	164,116,422
7	非營運存款	2,323,590	929,436	2,321,503	928,601
8	其他無擔保批發性資金	19,535,400	19,535,400	20,826,550	20,826,550
9	擔保融資交易	25,412,139	2,945,722	24,911,136	2,721,439
10	其他要求	128,455,994	19,236,089	123,442,921	19,465,967
11	衍生性商品交易現金流出	214,389	214,389	555,312	555,312
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	105,006,833	17,384,234	93,885,300	15,563,439
14	其他約定現金流出	1,395,279	1,395,279	3,031,695	3,031,695
15	其他或有融資負債	21,839,494	242,187	25,970,614	315,521
16	現金流出總額	829,412,948	205,835,598	829,118,544	208,135,714
現金流入					
17	擔保借出交易	-	-	-	-
18	履約暴險之現金流入	3,673,178	2,348,926	7,497,363	4,964,526
19	其他現金流入	540,756	540,756	10,560,583	10,560,583
20	現金流入總額	4,213,934	2,889,682	18,057,946	15,525,109
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		286,649,865		282,853,569
22	淨現金流出總計 ³		202,945,916		192,610,605
23	流動性覆蓋比率(%)		141.24		146.85

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。