

(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	627,866,070	2,999,706	1,064,421	124,572,905	756,503,102
利率敏感性負債	715,003,519	13,877,987	590,989	37,853,950	767,326,445
利率敏感性缺口	(87,137,449)	(10,878,281)	473,432	86,718,955	(10,823,343)
淨值					35,096,544
利率敏感性資產與負債比率					98.59
利率敏感性缺口與淨值比率					(30.84)

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	1,816,272	7,479	10,063	811,572	2,645,386
利率敏感性負債	1,788,881	51,885	7,485	-	1,848,251
利率敏感性缺口	27,391	(44,406)	2,578	811,572	797,135
淨值					-
利率敏感性資產與負債比率					143.13
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

	109年12月31日				108年12月31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	1,002,822	28,176,282	1	USD	958,503	28,743,591
	2	AUD	374,734	8,102,647	2	AUD	369,404	7,757,367
	3	EUR	2,147	74,166	3	EUR	9,798	329,420
	4	CNY	3,931	16,985	4	CNY	3,716	15,976
	5	NZD	64	1,297	5	NZD	66	1,329

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。