

(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	636,660,823	3,700,007	2,424,950	116,843,445	759,629,225
利率敏感性負債	728,653,738	13,188,386	1,459,480	37,873,950	781,175,554
利率敏感性缺口	(91,992,915)	(9,488,379)	965,470	78,969,495	(21,546,329)
淨值					33,191,325
利率敏感性資產與負債比率					97.24
利率敏感性缺口與淨值比率					(64.92)

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	1,874,862	25,077	1,413	1,052,320	2,953,672
利率敏感性負債	2,061,156	88,944	14,320	-	2,164,420
利率敏感性缺口	(186,294)	(63,867)	(12,907)	1,052,320	789,252
淨值					-
利率敏感性資產與負債比率					136.46
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

	110年3月31日				109年3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	806,510	22,991,193	1	USD	1,085,759	32,832,278
	2	AUD	362,378	7,857,224	2	AUD	643,610	12,046,763
	3	JPY	294,890	75,875	3	CNY	3,736	15,921
	4	EUR	2,002	66,848	4	EUR	191	6,377
	5	CNY	3,934	17,069	5	NZD	65	1,190

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。