

(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	643,732,231	2,978,472	3,375,709	133,722,547	783,808,959
利率敏感性負債	739,937,326	16,530,060	1,710,097	37,873,950	796,051,433
利率敏感性缺口	(96,205,095)	(13,551,588)	1,665,612	95,848,597	(12,242,474)
淨值					34,125,503
利率敏感性資產與負債比率					98.46
利率敏感性缺口與淨值比率					(35.87)

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	1,832,593	48,393	21,702	1,325,497	3,228,185
利率敏感性負債	2,128,749	167,223	27,737	-	2,323,709
利率敏感性缺口	(296,156)	(118,830)	(6,035)	1,325,497	904,476
淨值					-
利率敏感性資產與負債比率					138.92
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6月30日				109年6月30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	910,770	25,400,471	1	USD	932,859	27,453,122
	2	AUD	235,639	4,941,382	2	AUD	489,272	9,902,328
	3	EUR	1,675	55,580	3	CNY	3,644	15,176
	4	CNY	3,938	16,986	4	EUR	184	6,094
	5	JPY	23,535	5,938	5	NZD	65	1,225

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。