

(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	653,233,609	4,608,090	2,917,798	143,198,043	803,957,540
利率敏感性負債	761,330,323	14,997,955	216,496	37,873,960	814,418,734
利率敏感性缺口	(108,096,714)	(10,389,865)	2,701,302	105,324,083	(10,461,194)
淨值					33,739,660
利率敏感性資產與負債比率					98.72
利率敏感性缺口與淨值比率					(31.01)

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	1,694,291	11,191	31,185	1,410,560	3,147,227
利率敏感性負債	1,849,453	260,702	32,727	-	2,142,882
利率敏感性缺口	(155,162)	(249,511)	(1,542)	1,410,560	1,004,345
淨值					-
利率敏感性資產與負債比率					146.87
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9月30日				109年9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	1,041,736	29,026,919	1	USD	983,703	28,488,031
	2	AUD	212,782	4,271,219	2	AUD	579,593	11,975,496
	3	EUR	1,676	54,188	3	EUR	1,156	39,346
	4	CNY	3,998	17,210	4	CNY	3,928	16,706
	5	JPY	18,674	4,654	5	JPY	6,876	1,887

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。