

(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	652,774,610	3,566,876	2,262,393	148,387,026	806,990,905
利率敏感性負債	774,541,980	16,607,336	4,906,450	42,233,960	838,289,726
利率敏感性缺口	(121,767,370)	(13,040,460)	(2,644,057)	106,153,066	(31,298,821)
淨值					31,503,223
利率敏感性資產與負債比率					96.27
利率敏感性缺口與淨值比率					(99.35)

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	1,714,627	35,089	11,669	1,898,176	3,659,561
利率敏感性負債	1,958,200	389,542	36,351	-	2,384,093
利率敏感性缺口	(243,573)	(354,453)	(24,682)	1,898,176	1,275,468
淨值					-
利率敏感性資產與負債比率					153.50
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12月31日				109年12月31日			
			原幣(千元)	折合新臺幣			原幣(千元)	折合新臺幣
主要外幣淨部位 (市場風險)	1	USD	1,285,888	35,585,669	1	USD	1,002,822	28,176,282
	2	AUD	521,913	10,482,105	2	AUD	374,734	8,102,647
	3	CNY	2,841	12,340	3	EUR	2,147	74,166
	4	EUR	170	5,322	4	CNY	3,931	16,985
	5	JPY	8,475	2,038	5	NZD	64	1,297

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。