

(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	618,559,191	3,452,748	1,305,342	151,584,268	774,901,549
利率敏感性負債	790,139,458	19,549,298	3,126,250	44,820,010	857,635,016
利率敏感性缺口	(171,580,267)	(16,096,550)	(1,820,908)	106,764,258	(82,733,467)
淨值					26,534,752
利率敏感性資產與負債比率					90.35
利率敏感性缺口與淨值比率					(311.79)

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	1,219,881	16,520	360	3,309,646	4,546,407
利率敏感性負債	1,875,019	73,784	18,342	-	1,967,145
利率敏感性缺口	(655,138)	(57,264)	(17,982)	3,309,646	2,579,262
淨值					-
利率敏感性資產與負債比率					231.12
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

	111年3月31日				110年3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	2,552,912	73,008,186	1	USD	806,510	22,991,193
	2	AUD	1,254,761	26,914,256	2	AUD	362,378	7,857,224
	3	CNY	2,843	12,783	3	JPY	294,890	75,875
	4	EUR	167	5,329	4	EUR	2,002	66,848
	5	JPY	15,946	3,731	5	CNY	3,934	17,069

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。