

(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	603,604,852	6,598,986	3,985,198	251,273,746	865,462,782
利率敏感性負債	808,623,852	18,019,240	712,190	50,820,000	878,175,282
利率敏感性缺口	(205,019,000)	(11,420,254)	3,273,008	200,453,746	(12,712,500)
淨值					31,649,440
利率敏感性資產與負債比率					98.55
利率敏感性缺口與淨值比率					(40.17)

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	628,230	3,244	428,187	4,083,784	5,143,445
利率敏感性負債	4,890,532	1,239	6,089	-	4,897,860
利率敏感性缺口	(4,262,302)	2,005	422,098	4,083,784	245,585
淨值					-
利率敏感性資產與負債比率					105.01
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12月31日				110年12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	AUD	1,839,477	38,329,916	1	USD	1,285,888	35,585,669
	2	USD	255,109	7,835,177	2	AUD	521,913	10,482,105
	3	JPY	14,307,887	3,317,999	3	CNY	2,841	12,340
	4	CNY	552,041	2,434,445	4	EUR	170	5,322
	5	EUR	1,836	60,171	5	JPY	8,475	2,038

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。