

(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	574,260,826	6,099,920	2,035,657	252,799,284	835,195,687
利率敏感性負債	788,706,861	15,724,844	902,570	50,820,080	856,154,355
利率敏感性缺口	(214,446,035)	(9,624,924)	1,133,087	201,979,204	(20,958,668)
淨值					32,336,307
利率敏感性資產與負債比率					97.55
利率敏感性缺口與淨值比率					(64.81)

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	394,779	33,019	405,891	4,071,100	4,904,789
利率敏感性負債	4,582,672	101,276	6,535	-	4,690,483
利率敏感性缺口	(4,187,893)	(68,257)	399,356	4,071,100	214,306
淨值					-
利率敏感性資產與負債比率					104.57
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

	112年3月31日				111年3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	2,050,232	41,937,706	1	USD	2,552,912	73,008,186
	2	USD	256,011	7,788,377	2	AUD	1,254,761	26,914,256
	3	JPY	10,418,632	2,385,867	3	CNY	2,843	12,783
	4	EUR	36,636	1,215,772	4	EUR	167	5,329
	5	CNY	199,624	885,471	5	JPY	15,946	3,731

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。