

(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	574,038,861	5,699,227	7,559,132	245,113,647	832,410,867
利率敏感性負債	789,738,382	19,177,419	203,055	50,820,080	859,938,936
利率敏感性缺口	(215,699,521)	(13,478,192)	7,356,077	194,293,567	(27,528,069)
淨值					32,807,923
利率敏感性資產與負債比率					96.80
利率敏感性缺口與淨值比率					(83.91)

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	523,016	156,920	261,513	4,071,713	5,013,162
利率敏感性負債	4,721,913	111,681	4,653	-	4,838,247
利率敏感性缺口	(4,198,897)	45,239	256,860	4,071,713	174,915
淨值					-
利率敏感性資產與負債比率					103.62
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6月30日				111年6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	AUD	2,349,563	48,424,032	1	USD	2,198,370	65,339,957
	2	USD	253,403	7,888,423	2	AUD	1,546,343	31,682,247
	3	EUR	87,495	2,960,345	3	EUR	1,642	51,019
	4	JPY	5,288,838	1,137,629	4	CNY	2,846	12,634
	5	CNY	268	1,151	5	JPY	11,639	2,533

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。