

(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	584,904,847	7,472,632	6,671,139	254,629,339	853,677,957
利率敏感性負債	799,520,127	21,273,877	5,121,392	45,820,384	871,735,780
利率敏感性缺口	(214,615,280)	(13,801,245)	1,549,747	208,808,955	(18,057,823)
淨值					33,894,766
利率敏感性資產與負債比率					97.93
利率敏感性缺口與淨值比率					(53.28)

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	489,517	21,707	347,672	3,709,313	4,568,209
利率敏感性負債	4,367,788	230,331	4,448	-	4,602,567
利率敏感性缺口	(3,878,271)	(208,624)	343,224	3,709,313	(34,358)
淨值					-
利率敏感性資產與負債比率					99.25
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12月31日				111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	2,040,987	42,926,030	1	AUD	1,839,477	38,329,916
	2	CNY	400,472	1,736,247	2	USD	255,109	7,835,177
	3	EUR	44,908	1,529,825	3	JPY	14,307,887	3,317,999
	4	JPY	2,462,909	535,929	4	CNY	552,041	2,434,445
	5	USD	17,135	526,850	5	EUR	1,836	60,171

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。