

(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	557,349,520	3,689,302	15,526,473	222,328,966	798,894,261
利率敏感性負債	756,455,238	23,477,367	10,267,471	35,832,184	826,032,260
利率敏感性缺口	(199,105,718)	(19,788,065)	5,259,002	186,496,782	(27,137,999)
淨值					28,872,534
利率敏感性資產與負債比率					96.71
利率敏感性缺口與淨值比率					(93.99)

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	516,478	28,532	291,671	3,450,425	4,287,106
利率敏感性負債	3,916,632	8,901	3,637	-	3,929,170
利率敏感性缺口	(3,400,154)	19,631	288,034	3,450,425	357,936
淨值					-
利率敏感性資產與負債比率					109.11
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

	113年6月30日				112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	1,864,798	40,227,053	1	AUD	2,349,563	48,424,032
	2	USD	440,784	14,321,060	2	USD	253,403	7,888,423
	3	CNY	670,095	2,986,146	3	EUR	87,495	2,960,345
	4	EUR	4,932	171,531	4	JPY	5,288,838	1,137,629
	5	JPY	739,630	149,479	5	CNY	268	1,151

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。