

市場風險敏感性

(一)利率敏感性資訊

單位：%

	94.12.31	93.12.31
利率敏感性資產與負債比率	69.16	74.67
利率敏感性缺口與淨值比率	(415.83)	(341.69)

註一：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。

註二：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 (指一年內新臺幣利率敏感性資產與利率敏感性負債)。

註三：利率敏感性缺口 = 利率敏感性資產 - 利率敏感性負債。

(二)主要外幣淨部位

單位：新台幣千元，%

	94.12.31		93.12.31	
	原幣	折合新台幣	原幣	折合新台幣
主要外幣淨部位(市場風險)	USD	3,379	USD	19,369
		111,007		618,207
	NZD	389,349	NZD	562
		108,901		13,677
	HKD	6,292	EUR	202
	26,661	HKD	1,932	
	7,258		7,931	
	187	JPY	19,540	
	6,497		6,075	
	270			

註一：主要外幣係折算為同一幣別後，部位金額較高之前五者。

註二：主要外幣淨部位係各幣別淨部位之絕對值。