

利率敏感性資產負債分析表（新臺幣）

九十六年九月三十日

單位：新臺幣仟元，%

項目	1 天至 90 天 (含)	91 天至 180 天 (含)	181 天至 1 年 (含)	1 年以上	合計
利率敏感性資產	1,798,003,354	77,294,462	68,947,086	67,967,021	2,012,211,923
利率敏感性負債	1,167,635,822	641,769,849	86,759,581	25,424,669	1,921,589,921
利率敏感性缺口	630,367,532	-564,475,387	-17,812,495	42,542,352	90,622,002
淨值					97,921,054
利率敏感性資產與負債比率					104.72
利率敏感性缺口與淨值比率					92.55

- 註：
- 一、 本表係填寫總行及國內外分支機構新臺幣部分（不含外幣）之金額。
 - 二、 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。
 - 三、 利率敏感性缺口＝利率敏感性資產－利率敏感性負債。
 - 四、 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）

九十六年九月三十日

單位：美金仟元，%

項目	1 天至 90 天 (含)	91 天至 180 天 (含)	181 天至 1 年 (含)	1 年以上	合計
利率敏感性資產	4,103,635	807,982	51,663	153,849	5,117,129
利率敏感性負債	4,155,050	596,957	72,350	0	4,824,357
利率敏感性缺口	-51,415	211,025	-20,687	153,849	292,772
淨值					47,060
利率敏感性資產與負債比率					106.06
利率敏感性缺口與淨值比率					622.12
註：淨值部分係屬海外分行的淨值					

- 註：
- 一、 本表係填報總行及國內分支機構、國際金融業務分行及海外分支機構合計美金之金額，不包括或有資產及或有負債項目。
 - 二、 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。
 - 三、 利率敏感性缺口＝利率敏感性資產－利率敏感性負債
 - 四、 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）