

利率敏感性資產負債分析表（新臺幣）

九十六年十二月三十一日

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	1,801,570,953	144,562,858	73,991,736	60,713,143	2,080,838,690
利率敏感性負債	1,234,986,491	624,881,244	89,994,128	24,660,033	1,974,521,896
利率敏感性缺口	566,584,462	-480,318,386	-16,002,392	36,053,110	106,316,794
淨值					100,660,877
利率敏感性資產與負債比率					105.38
利率敏感性缺口與淨值比率					105.62

- 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）

九十六年十二月三十一日

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	3,957,397	1,075,901	51,832	126,380	5,211,510
利率敏感性負債	3,999,351	739,169	83,446	0	4,821,966
利率敏感性缺口	-41,954	336,732	-31,614	126,380	389,544
*淨值					54,730
利率敏感性資產與負債比率					108.08
利率敏感性缺口與淨值比率					711.76
*係海外分行淨值					

- 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）。