

利率敏感性資產負債分析表（新臺幣）

九十七年六月三十日

單位：新臺幣仟元，%

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	1,797,429,685	108,055,933	60,318,544	74,152,145	2,039,956,307
利率敏感性負債	1,230,401,817	626,578,701	116,349,043	11,196,471	1,984,526,032
利率敏感性缺口	567,027,868	-518,522,768	-56,030,499	62,955,674	55,430,275
淨值					102,961,747
利率敏感性資產與負債比率					102.79
利率敏感性缺口與淨值比率					53.84

- 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）

九十七年六月三十日

單位：美金仟元，%

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	5,793,154	803,984	71,104	83,110	6,751,352
利率敏感性負債	5,335,070	547,390	8,136	0	5,890,596
利率敏感性缺口	458,084	256,594	62,968	83,110	860,756
*淨值					54,126
利率敏感性資產與負債比率					114.61
利率敏感性缺口與淨值比率					1,590.28
*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）。