利率敏感性資產負債分析表（新臺幣）

中華民國一百一十四年六月三十日

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)	超過 1 年	合計
利率敏感性資產	3,389,448,991	209,208,992	68,864,026	471,411,830	4,138,933,839
利率敏感性負債	1,412,807,242	2,092,171,752	143,982,144	73,412,429	3,722,373,567
利率敏感性缺口	1,976,641,749	-1,882,962,760	-75,118,118	397,999,401	416,560,272
淨值					244,250,125
利率敏感性資產與負債比率					111.19
利率敏感性缺口與淨值比率					170.55

說明 1、銀行部分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。

說明 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。

說明 3、利率敏感性缺口 = 利率敏感性資產 - 利率敏感性負債。

說明 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)	超過 1 年	合計
利率敏感性資產	11,259,913	1,805,772	947,651	3,017,426	17,030,762
利率敏感性負債	21,469,368	1,483,645	1,998,979	30,000	24,981,992
利率敏感性缺口	-10,209,455	322,127	-1,051,328	2,987,426	-7,951,230
淨值					1,162,937
利率敏感性資產與負債比率					68.17
利率敏感性缺口與淨值比率					-683.72

說明 1、銀行部分係指全行美金之金額，且不包括或有資產及或有負債項目。

說明 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。

說明 3、利率敏感性缺口 = 利率敏感性資產 - 利率敏感性負債。

說明 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）