

## 利率敏感性資產負債分析表（新臺幣）

中華民國 111 年 9 月 30 日

單位：新臺幣千元，%

項目	0 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	1,815,633,921	953,129,765	1,029,378,749	2,236,195,379	6,034,337,814
利率敏感性負債	852,591,778	3,877,772,059	1,740,135,851	421,127,120	6,891,626,808
利率敏感性缺口	963,042,143	-2,924,642,294	-710,757,102	1,815,068,259	-857,288,994
淨值					137,193,409
利率敏感性資產與負債比率					87.56%
利率敏感性缺口與淨值比率					-624.88%

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）。
- 四、利率敏感性缺口＝利率敏感性資產－利率敏感性負債。
- 五、本網頁所揭露資訊為本公司自行編製數。

## 利率敏感性資產負債分析表（美金）

單位：美金千元，%

項目	0 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	205,727	37,057	13,707	19,356,795	19,613,286
利率敏感性負債	0	0	0	0	0
利率敏感性缺口	205,727	37,057	13,707	19,356,795	19,613,286
淨值					0
利率敏感性資產與負債比率					N/A
利率敏感性缺口與淨值比率					N/A

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）。
- 四、利率敏感性缺口＝利率敏感性資產－利率敏感性負債。
- 五、本網頁所揭露資訊為本公司自行編製數。