

利率敏感性資產負債分析表（新臺幣）

中華民國 109 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	2,047,663,986	1,090,744,965	687,453,137	1,852,242,318	5,678,104,406
利率敏感性負債	839,882,265	3,512,502,591	1,645,561,416	390,728,211	6,388,674,483
利率敏感性缺口	1,207,781,721	-2,421,757,626	-958,108,279	1,461,514,107	-710,570,077
淨值					164,405,454
利率敏感性資產與負債比率					88.88%
利率敏感性缺口與淨值比率					-432.21%

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	1,557,671	76,192	153,299	14,966,201	16,753,364
利率敏感性負債	9,532	15,020	0	0	24,553
利率敏感性缺口	1,548,139	61,172	153,299	14,966,201	16,728,811
淨值					0
利率敏感性資產與負債比率					68234.54%
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。