

利率敏感性資產負債分析表

利率敏感性資產負債分析表(新臺幣)
民國106年9月30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	\$ 506,698,521	\$ 890,349,737	\$ 66,219,308	\$ 89,028,890	\$ 1,552,296,456
利率敏感性負債	502,949,107	664,877,583	68,942,355	28,303,412	1,265,072,457
利率敏感性缺口	\$ 3,749,414	\$ 225,472,154	(\$ 2,723,047)	\$ 60,725,478	\$ 287,223,999
淨值					\$ 252,840,632
利率敏感性資產與負債比率					122.70%
利率敏感性缺口與淨值比率					113.60%

1. 本表係填寫全行新臺幣之金額，且不包括或有資產及或有負債項目。
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。
3. 利率敏感性缺口 = 利率敏感性資產 - 利率敏感性負債。
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。

利率敏感性資產負債分析表(美金)
民國106年9月30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	\$ 37,983,615	\$ 853,915	\$ 480,378	\$ 399,823	\$ 39,717,731
利率敏感性負債	38,535,708	2,063,769	1,471,724	1,779	42,072,980
利率敏感性缺口	(\$ 552,093)	(\$ 1,209,854)	(\$ 991,346)	\$ 398,044	(\$ 2,355,249)
淨值					\$ 443,077
利率敏感性資產與負債比率					94.40%
利率敏感性缺口與淨值比率					(531.57%)

1. 本表係填報全行美金之金額，且不包括或有資產及或有負債項目。
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。
3. 利率敏感性缺口 = 利率敏感性資產 - 利率敏感性負債。
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。