

(格式八~一)

利率敏感性資產負債分析表（新臺幣）

中華民國 101 年 9 月 30 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	509,978,624	33,851,514	7,090,030	152,390,775	703,310,943
利率敏感性負債	686,757,500	4,126,507	90,463	2,717,924	693,692,394
利率敏感性缺口	(176,778,876)	29,725,007	6,999,567	149,672,851	9,618,549
淨值					23,329,796
利率敏感性資產與負債比率					101.39
利率敏感性缺口與淨值比率					41.23

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。

利率敏感性資產負債分析表（美金）

中華民國 101 年 9 月 30 日

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	-	-	-	-	-
利率敏感性負債	-	-	-	-	-
利率敏感性缺口	-	-	-	-	-
淨值					-
利率敏感性資產與負債比率					-
利率敏感性缺口與淨值比率					-

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。

(格式八~二)

主要外幣淨部位

單位：新臺幣千元

	101 年 9 月 30 日				100 年 9 月 30 日			
主要外幣淨部位 (市場風險)		原幣 (千元)		折合新臺幣		原幣 (千元)		折合新臺幣
	1	USD	10.549	309	1	10.549	322	
	2	JPY	1,100	416	2	1,100	439	
	3	EUR	1	38	3	1	41	
	4	CNY	95.8	446	4	97	463	
	5				5			

註：一、主要外幣係折算為同一幣別後，部位金額較高之前五者。

二、主要外幣淨部位係各幣別淨部位之絕對值。

三、本表信託投資公司不適用。