

表六

## 本國銀行衍生性金融商品餘額統計

107 年 09 月 30 日

單位：新臺幣百萬元

| 名 目 本 金  | 合 計        | 中國輸出入銀行 | 臺灣銀行      | 台北富邦銀行    | 高雄銀行  | 臺灣土地銀行 | 合庫商業銀行  | 第一商業銀行  | 華南商業銀行  | 彰化商業銀行  | 兆豐國際商銀  | 國泰世華商銀    | 花旗(台灣)銀   |
|----------|------------|---------|-----------|-----------|-------|--------|---------|---------|---------|---------|---------|-----------|-----------|
| 利率有關契約   | 12,576,461 | 4,000   | 125,400   | 1,004,293 | -     | 20,583 | 29,413  | 458,594 | 21,152  | 431,156 | 122,332 | 2,779,052 | 245,031   |
| 交易目的     | 12,363,802 | 4,000   | 119,408   | 881,995   | -     | 18,919 | 26,213  | 458,594 | 21,152  | 422,956 | 122,332 | 2,779,052 | 245,031   |
| 非交易目的    | 212,659    | -       | 5,992     | 122,298   | -     | 1,664  | 3,200   | -       | -       | 8,200   | -       | -         | -         |
| 匯率有關契約   | 26,705,373 | 3,733   | 1,243,906 | 3,589,459 | 9,807 | 39,173 | 451,988 | 473,015 | 347,909 | 353,181 | 690,216 | 2,818,731 | 968,567   |
| 交易目的     | 26,641,729 | 3,733   | 1,243,906 | 3,589,459 | 9,807 | 39,173 | 451,988 | 473,015 | 347,909 | 353,181 | 690,216 | 2,818,731 | 968,567   |
| 非交易目的    | 63,644     | -       | -         | -         | -     | -      | -       | -       | -       | -       | -       | -         | -         |
| 權益證券有關契約 | 26,809     | -       | -         | 8,000     | -     | -      | 196     | -       | -       | -       | -       | -         | -         |
| 交易目的     | 26,809     | -       | -         | 8,000     | -     | -      | 196     | -       | -       | -       | -       | -         | -         |
| 非交易目的    | -          | -       | -         | -         | -     | -      | -       | -       | -       | -       | -       | -         | -         |
| 商品有關契約   | 7,342      | -       | 428       | 787       | -     | -      | -       | -       | -       | -       | -       | 404       | 1,968     |
| 交易目的     | 7,342      | -       | 428       | 787       | -     | -      | -       | -       | -       | -       | -       | 404       | 1,968     |
| 非交易目的    | -          | -       | -         | -         | -     | -      | -       | -       | -       | -       | -       | -         | -         |
| 信用有關契約   | 50,699     | -       | -         | -         | -     | -      | -       | -       | -       | -       | 17,610  | -         | -         |
| 交易目的     | 50,699     | -       | -         | -         | -     | -      | -       | -       | -       | -       | 17,610  | -         | -         |
| 非交易目的    | -          | -       | -         | -         | -     | -      | -       | -       | -       | -       | -       | -         | -         |
| 其他有關契約   | -          | -       | -         | -         | -     | -      | -       | -       | -       | -       | -       | -         | -         |
| 交易目的     | -          | -       | -         | -         | -     | -      | -       | -       | -       | -       | -       | -         | -         |
| 非交易目的    | -          | -       | -         | -         | -     | -      | -       | -       | -       | -       | -       | -         | -         |
| 合 計      | 39,366,684 | 7,733   | 1,369,734 | 4,602,539 | 9,807 | 59,756 | 481,597 | 931,609 | 369,061 | 784,337 | 830,158 | 5,598,187 | 1,215,566 |

註：「交易目的」包括經常性自營交易(regularly dealing)、意圖從短期市價波動賺取利潤所持有之部位、為配合客戶需求所持有之部位及為規避交易目的契約之風險而從事之避險交易。其他非屬上述目的則為「非交易目的」。

銀行應客戶需求承作之交易及為規避交易風險而承作之避險交易，均屬交易目的。

表六

## 本國銀行衍生性金融商品餘額統計

107 年 09 月 30 日

單位：新臺幣百萬元

| 名 目 本 金  | 上海商業銀行 | 聯邦商業銀行 | 遠東國際商銀  | 元大商業銀行  | 永豐商業銀行    | 玉山商業銀行  | 凱基商業銀行    | 台新國際商銀    | 日盛國際商銀 | 安泰商業銀行  | 中國信託商銀    | 匯豐(台灣)銀   | 台灣新光銀行  |
|----------|--------|--------|---------|---------|-----------|---------|-----------|-----------|--------|---------|-----------|-----------|---------|
| 利率有關契約   | 2,110  | -      | 154,149 | 19,277  | 787,690   | 78,642  | 1,754,108 | 1,442,070 | 87,537 | 53,123  | 1,409,105 | 523,466   | 16,662  |
| 交易目的     | -      | -      | 154,149 | 19,277  | 787,690   | 78,642  | 1,754,108 | 1,442,070 | 87,537 | 53,123  | 1,400,205 | 483,166   | 16,662  |
| 非交易目的    | 2,110  | -      | -       | -       | -         | -       | -         | -         | -      | -       | 8,900     | 40,300    | -       |
| 匯率有關契約   | 35,354 | 51,406 | 460,796 | 241,924 | 1,757,229 | 595,482 | 1,646,388 | 2,393,405 | 3,962  | 51,421  | 3,014,054 | 2,073,339 | 218,065 |
| 交易目的     | 35,354 | 51,406 | 460,796 | 241,924 | 1,757,229 | 595,482 | 1,646,388 | 2,393,405 | 3,962  | 51,421  | 2,981,245 | 2,073,339 | 218,065 |
| 非交易目的    | -      | -      | -       | -       | -         | -       | -         | -         | -      | -       | 32,809    | -         | -       |
| 權益證券有關契約 | 29     | -      | -       | 5,681   | 354       | -       | 107       | 534       | -      | 244     | 8,837     | 1,562     | 1,265   |
| 交易目的     | 29     | -      | -       | 5,681   | 354       | -       | 107       | 534       | -      | 244     | 8,837     | 1,562     | 1,265   |
| 非交易目的    | -      | -      | -       | -       | -         | -       | -         | -         | -      | -       | -         | -         | -       |
| 商品有關契約   | -      | -      | 471     | -       | 9         | 426     | 1,180     | 74        | -      | -       | 719       | 75        | -       |
| 交易目的     | -      | -      | 471     | -       | 9         | 426     | 1,180     | 74        | -      | -       | 719       | 75        | -       |
| 非交易目的    | -      | -      | -       | -       | -         | -       | -         | -         | -      | -       | -         | -         | -       |
| 信用有關契約   | -      | -      | 32,703  | -       | -         | -       | -         | 355       | -      | -       | 31        | -         | -       |
| 交易目的     | -      | -      | 32,703  | -       | -         | -       | -         | 355       | -      | -       | 31        | -         | -       |
| 非交易目的    | -      | -      | -       | -       | -         | -       | -         | -         | -      | -       | -         | -         | -       |
| 其他有關契約   | -      | -      | -       | -       | -         | -       | -         | -         | -      | -       | -         | -         | -       |
| 交易目的     | -      | -      | -       | -       | -         | -       | -         | -         | -      | -       | -         | -         | -       |
| 非交易目的    | -      | -      | -       | -       | -         | -       | -         | -         | -      | -       | -         | -         | -       |
| 合 計      | 37,493 | 51,406 | 648,119 | 266,882 | 2,545,282 | 674,550 | 3,401,783 | 3,836,438 | 91,499 | 104,788 | 4,432,746 | 2,598,442 | 235,992 |

註：「交易目的」包括經常性自營交易(regularly dealing)、意圖從短期市價波動賺取利潤所持有之部位、為配合客戶需求所持有之部位及為規避交易目的契約之風險而從事之避險交易。其他非屬上述目的則為「非交易目的」。

銀行應客戶需求承作之交易及為規避交易風險而承作之避險交易，均屬交易目的。

表六

## 本國銀行衍生性金融商品餘額統計

107 年 09 月 30 日

單位：新臺幣百萬元

| 名 目 本 金  | 陽信商業銀行 | 板信商業銀行 | 臺灣中小企銀  | 渣打國際商銀    | 台中商業銀行 | 京城商業銀行 | 華泰商業銀行 | 三信商業銀行 | 王道商業銀行  | 全國農業金庫 | 瑞興商業銀行 | 星展(台灣)銀 | 澳盛(台灣)銀   |
|----------|--------|--------|---------|-----------|--------|--------|--------|--------|---------|--------|--------|---------|-----------|
| 利率有關契約   | -      | 116    | 18,645  | 685,303   | 3,883  | -      | 1,751  | 980    | 17,481  | -      | 2,042  | 247,022 | 30,293    |
| 交易目的     | -      | 116    | -       | 683,953   | 3,883  | -      | 1,751  | 980    | 17,481  | -      | 2,042  | 247,022 | 30,293    |
| 非交易目的    | -      | -      | 18,645  | 1,350     | -      | -      | -      | -      | -       | -      | -      | -       | -         |
| 匯率有關契約   | 1,695  | 1,592  | 129,763 | 1,328,386 | 31,206 | 3,074  | 852    | 1,246  | 82,789  | 65,157 | 506    | 436,696 | 1,089,901 |
| 交易目的     | 1,695  | 1,592  | 129,763 | 1,310,405 | 31,206 | 3,074  | 852    | 1,246  | 82,789  | 65,157 | 506    | 423,842 | 1,089,901 |
| 非交易目的    | -      | -      | -       | 17,981    | -      | -      | -      | -      | -       | -      | -      | 12,854  | -         |
| 權益證券有關契約 | -      | -      | -       | -         | -      | -      | -      | -      | -       | -      | -      | -       | -         |
| 交易目的     | -      | -      | -       | -         | -      | -      | -      | -      | -       | -      | -      | -       | -         |
| 非交易目的    | -      | -      | -       | -         | -      | -      | -      | -      | -       | -      | -      | -       | -         |
| 商品有關契約   | -      | -      | -       | 683       | -      | -      | -      | -      | -       | -      | -      | -       | 118       |
| 交易目的     | -      | -      | -       | 683       | -      | -      | -      | -      | -       | -      | -      | -       | 118       |
| 非交易目的    | -      | -      | -       | -         | -      | -      | -      | -      | -       | -      | -      | -       | -         |
| 信用有關契約   | -      | -      | -       | -         | -      | -      | -      | -      | -       | -      | -      | -       | -         |
| 交易目的     | -      | -      | -       | -         | -      | -      | -      | -      | -       | -      | -      | -       | -         |
| 非交易目的    | -      | -      | -       | -         | -      | -      | -      | -      | -       | -      | -      | -       | -         |
| 其他有關契約   | -      | -      | -       | -         | -      | -      | -      | -      | -       | -      | -      | -       | -         |
| 交易目的     | -      | -      | -       | -         | -      | -      | -      | -      | -       | -      | -      | -       | -         |
| 非交易目的    | -      | -      | -       | -         | -      | -      | -      | -      | -       | -      | -      | -       | -         |
| 合 計      | 1,695  | 1,708  | 148,408 | 2,014,372 | 35,089 | 3,074  | 2,603  | 2,226  | 100,270 | 65,157 | 2,548  | 683,718 | 1,120,312 |

註：「交易目的」包括經常性自營交易(regularly dealing)、意圖從短期市價波動賺取利潤所持有之部位、為配合客戶需求所持有之部位及為規避交易目的契約之風險而從事之避險交易。其他非屬上述目的則為「非交易目的」。  
銀行應客戶需求承作之交易及為規避交易風險而承作之避險交易，均屬交易目的。