

表六

本國銀行衍生性金融商品餘額統計

109 年 03 月 31 日

單位：新臺幣百萬元

| 名 目 本 金  | 合 計        | 臺灣銀行      | 臺灣土地銀行  | 合作金庫銀行  | 第一商業銀行    | 華南商業銀行  | 彰化商業銀行  | 上海商業銀行 | 台北富邦銀行    | 國泰世華商銀    | 中國輸出入銀行 | 高雄銀行  | 兆豐國際商銀  | 全國農業金庫 | 花旗(台灣)銀   | 王道商業銀行 |
|----------|------------|-----------|---------|---------|-----------|---------|---------|--------|-----------|-----------|---------|-------|---------|--------|-----------|--------|
| 利率有關契約   | 13,906,541 | 120,661   | 20,330  | 1,700   | 503,156   | 35,470  | 312,862 | 3,876  | 1,028,430 | 2,174,168 | 10,200  | 0     | 81,831  | 0      | 401,271   | 8,225  |
| 交易目的     | 13,623,351 | 117,896   | 18,727  | 0       | 503,156   | 35,470  | 304,662 | 0      | 867,201   | 2,174,168 | 10,200  | 0     | 81,831  | 0      | 401,271   | 8,225  |
| 非交易目的    | 283,190    | 2,765     | 1,603   | 1,700   | 0         | 0       | 8,200   | 3,876  | 161,229   | 0         | 0       | 0     | 0       | 0      | 0         | 0      |
| 匯率有關契約   | 25,613,247 | 1,163,347 | 111,485 | 321,133 | 777,963   | 297,897 | 477,848 | 53,675 | 3,149,161 | 2,908,106 | 67      | 4,103 | 664,994 | 52,570 | 1,096,104 | 77,318 |
| 交易目的     | 25,508,174 | 1,158,665 | 111,485 | 321,133 | 777,963   | 297,897 | 477,848 | 53,675 | 3,149,161 | 2,908,106 | 67      | 4,103 | 664,994 | 52,570 | 1,096,104 | 77,318 |
| 非交易目的    | 105,073    | 4,682     | 0       | 0       | 0         | 0       | 0       | 0      | 0         | 0         | 0       | 0     | 0       | 0      | 0         | 0      |
| 權益證券有關契約 | 31,204     | 0         | 0       | 0       | 0         | 0       | 0       | 33     | 7,829     | 0         | 0       | 0     | 0       | 0      | 0         | 0      |
| 交易目的     | 31,204     | 0         | 0       | 0       | 0         | 0       | 0       | 33     | 7,829     | 0         | 0       | 0     | 0       | 0      | 0         | 0      |
| 非交易目的    | 0          | 0         | 0       | 0       | 0         | 0       | 0       | 0      | 0         | 0         | 0       | 0     | 0       | 0      | 0         | 0      |
| 商品有關契約   | 8,811      | 0         | 0       | 0       | 0         | 0       | 0       | 0      | 413       | 238       | 0       | 0     | 0       | 0      | 2,670     | 0      |
| 交易目的     | 8,811      | 0         | 0       | 0       | 0         | 0       | 0       | 0      | 413       | 238       | 0       | 0     | 0       | 0      | 2,670     | 0      |
| 非交易目的    | 0          | 0         | 0       | 0       | 0         | 0       | 0       | 0      | 0         | 0         | 0       | 0     | 0       | 0      | 0         | 0      |
| 信用有關契約   | 49,032     | 0         | 0       | 0       | 0         | 0       | 0       | 0      | 0         | 0         | 0       | 0     | 20,565  | 0      | 0         | 0      |
| 交易目的     | 49,032     | 0         | 0       | 0       | 0         | 0       | 0       | 0      | 0         | 0         | 0       | 0     | 20,565  | 0      | 0         | 0      |
| 非交易目的    | 0          | 0         | 0       | 0       | 0         | 0       | 0       | 0      | 0         | 0         | 0       | 0     | 0       | 0      | 0         | 0      |
| 其他有關契約   | 0          | 0         | 0       | 0       | 0         | 0       | 0       | 0      | 0         | 0         | 0       | 0     | 0       | 0      | 0         | 0      |
| 交易目的     | 0          | 0         | 0       | 0       | 0         | 0       | 0       | 0      | 0         | 0         | 0       | 0     | 0       | 0      | 0         | 0      |
| 非交易目的    | 0          | 0         | 0       | 0       | 0         | 0       | 0       | 0      | 0         | 0         | 0       | 0     | 0       | 0      | 0         | 0      |
| 合 計      | 39,608,835 | 1,284,008 | 131,815 | 322,833 | 1,281,119 | 333,367 | 790,710 | 57,584 | 4,185,833 | 5,082,512 | 10,267  | 4,103 | 767,390 | 52,570 | 1,500,045 | 85,543 |

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」。

表六

| 名 目 本 金  | 臺灣中小企銀  | 渣打國際商銀    | 台中商業銀行 | 京城商業銀行 | 匯豐(台灣)銀   | 瑞興商業銀行 | 華泰商業銀行 | 台灣新光銀行  | 陽信商業銀行 | 板信商業銀行 | 三信商業銀行 | 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    |
|----------|---------|-----------|--------|--------|-----------|--------|--------|---------|--------|--------|--------|--------|---------|---------|-----------|-----------|
| 利率有關契約   | 34,828  | 1,265,566 | 3,910  | 0      | 477,557   | 991    | 1,163  | 43,813  | 0      | 0      | 1,872  | 61     | 187,499 | 19,644  | 905,944   | 580,564   |
| 交易目的     | 5,725   | 1,264,216 | 3,910  | 0      | 425,057   | 991    | 1,163  | 43,813  | 0      | 0      | 1,872  | 61     | 187,499 | 19,644  | 905,944   | 580,564   |
| 非交易目的    | 29,103  | 1,350     | 0      | 0      | 52,500    | 0      | 0      | 0       | 0      | 0      | 0      | 0      | 0       | 0       | 0         | 0         |
| 匯率有關契約   | 237,185 | 961,268   | 40,428 | 4,876  | 1,945,864 | 982    | 282    | 260,190 | 555    | 2,119  | 985    | 74,266 | 511,394 | 149,207 | 1,400,214 | 1,041,904 |
| 交易目的     | 237,185 | 956,219   | 40,428 | 4,876  | 1,892,939 | 982    | 282    | 260,190 | 555    | 2,119  | 985    | 74,266 | 511,394 | 149,207 | 1,400,214 | 1,041,904 |
| 非交易目的    | 0       | 5,049     | 0      | 0      | 52,925    | 0      | 0      | 0       | 0      | 0      | 0      | 0      | 0       | 0       | 0         | 0         |
| 權益證券有關契約 | 189     | 0         | 0      | 0      | 526       | 0      | 0      | 1,421   | 0      | 0      | 0      | 0      | 23      | 66      | 73        | 0         |
| 交易目的     | 189     | 0         | 0      | 0      | 526       | 0      | 0      | 1,421   | 0      | 0      | 0      | 0      | 23      | 66      | 73        | 0         |
| 非交易目的    | 0       | 0         | 0      | 0      | 0         | 0      | 0      | 0       | 0      | 0      | 0      | 0      | 0       | 0       | 0         | 0         |
| 商品有關契約   | 0       | 1,214     | 0      | 0      | 214       | 0      | 0      | 0       | 0      | 0      | 0      | 0      | 0       | 0       | 689       | 336       |
| 交易目的     | 0       | 1,214     | 0      | 0      | 214       | 0      | 0      | 0       | 0      | 0      | 0      | 0      | 0       | 0       | 689       | 336       |
| 非交易目的    | 0       | 0         | 0      | 0      | 0         | 0      | 0      | 0       | 0      | 0      | 0      | 0      | 0       | 0       | 0         | 0         |
| 信用有關契約   | 0       | 0         | 0      | 0      | 0         | 0      | 0      | 0       | 0      | 0      | 0      | 0      | 28,406  | 0       | 0         | 0         |
| 交易目的     | 0       | 0         | 0      | 0      | 0         | 0      | 0      | 0       | 0      | 0      | 0      | 0      | 28,406  | 0       | 0         | 0         |
| 非交易目的    | 0       | 0         | 0      | 0      | 0         | 0      | 0      | 0       | 0      | 0      | 0      | 0      | 0       | 0       | 0         | 0         |
| 其他有關契約   | 0       | 0         | 0      | 0      | 0         | 0      | 0      | 0       | 0      | 0      | 0      | 0      | 0       | 0       | 0         | 0         |
| 交易目的     | 0       | 0         | 0      | 0      | 0         | 0      | 0      | 0       | 0      | 0      | 0      | 0      | 0       | 0       | 0         | 0         |
| 非交易目的    | 0       | 0         | 0      | 0      | 0         | 0      | 0      | 0       | 0      | 0      | 0      | 0      | 0       | 0       | 0         | 0         |
| 合 計      | 272,202 | 2,228,048 | 44,338 | 4,876  | 2,424,161 | 1,973  | 1,445  | 305,424 | 555    | 2,119  | 2,857  | 74,327 | 727,322 | 168,917 | 2,306,920 | 1,622,804 |

表六

| 名 目 本 金  | 凱基商業銀行    | 星展(台灣)銀 | 台新國際商銀    | 日盛商業銀行 | 安泰商業銀行  | 中國信託商銀    |
|----------|-----------|---------|-----------|--------|---------|-----------|
| 利率有關契約   | 1,670,521 | 302,049 | 1,269,372 | 30,899 | 50,059  | 2,358,049 |
| 交易目的     | 1,649,657 | 302,049 | 1,269,372 | 30,899 | 50,059  | 2,358,049 |
| 非交易目的    | 20,864    | 0       | 0         | 0      | 0       | 0         |
| 匯率有關契約   | 1,518,951 | 457,664 | 1,454,268 | 3,488  | 53,641  | 4,337,745 |
| 交易目的     | 1,518,951 | 450,621 | 1,454,268 | 3,488  | 53,641  | 4,302,371 |
| 非交易目的    | 0         | 7,043   | 0         | 0      | 0       | 35,374    |
| 權益證券有關契約 | 88        | 421     | 302       | 0      | 231     | 20,002    |
| 交易目的     | 88        | 421     | 302       | 0      | 231     | 20,002    |
| 非交易目的    | 0         | 0       | 0         | 0      | 0       | 0         |
| 商品有關契約   | 119       | 7       | 152       | 0      | 0       | 2,759     |
| 交易目的     | 119       | 7       | 152       | 0      | 0       | 2,759     |
| 非交易目的    | 0         | 0       | 0         | 0      | 0       | 0         |
| 信用有關契約   | 0         | 0       | 0         | 0      | 0       | 61        |
| 交易目的     | 0         | 0       | 0         | 0      | 0       | 61        |
| 非交易目的    | 0         | 0       | 0         | 0      | 0       | 0         |
| 其他有關契約   | 0         | 0       | 0         | 0      | 0       | 0         |
| 交易目的     | 0         | 0       | 0         | 0      | 0       | 0         |
| 非交易目的    | 0         | 0       | 0         | 0      | 0       | 0         |
| 合 計      | 3,189,679 | 760,141 | 2,724,094 | 34,387 | 103,931 | 6,718,616 |