

金融商品交易資訊

<一>國內金融商品交易資訊

投資國內金融商品交易資訊

中華民國101年6月30日

單位:新台幣千元

金融商品名稱		帳列之會計科目	原始投資成本	評價調整金額	累計減損金額	帳列餘額	衡量方法	採公平價值衡量者其公平價值產生之來源
股票	上市櫃公司	交易目的	3,009,581	-128,358		2,881,223	市價法	櫃買中心集中市場
	上市櫃公司	指定衡量					市價法	櫃買中心集中市場
	上市櫃公司	備供出售	7,285,600	-653,809		6,631,791	市價法	櫃買中心集中市場
	非上市櫃公司	成本衡量	17,612,928		-1,008,135	16,604,793	市價法	櫃買中心集中市場
債券	政府債券	交易目的	301,021	-444		300,577	市價法	櫃買中心
	政府債券	指定衡量					市價法	櫃買中心
	政府債券	備供出售	9,093,783	82,364		9,176,147	市價法	櫃買中心
	政府債券	持有至到期					持有至到期	
	金融債券	交易目的					現金流量折現法	bloomberg
	金融債券	指定衡量					現金流量折現法	bloomberg
	金融債券	備供出售	300,000	2,400		302,400	現金流量折現法	bloomberg
	金融債券	持有至到期					持有至到期	
	公司債	交易目的					現金流量折現法	bloomberg
	公司債	指定衡量	18,224,169	1,461,819		19,685,988	現金流量折現法	bloomberg
	公司債	備供出售	8,508,512	77,384		8,585,896	現金流量折現法	bloomberg
	公司債	持有至到期					持有至到期	
	其他債務商品	交易目的					現金流量折現法	reuters6165
	其他債務商品	指定衡量					現金流量折現法	reuters6165
	其他債務商品	備供出售	6,408,688	1,224		6,409,912	現金流量折現法	reuters6165
	其他債務商品	持有至到期	148,800,000			148,800,000	持有至到期	
其他	證券化商品	交易目的					市價法	reuters6165
	證券化商品	指定衡量					市價法	reuters6166
	證券化商品	備供出售	3,922,599	4,128		3,926,727	市價法	reuters6165
	證券化商品	持有至到期					持有至到期	
	證券化商品	其他投資					市價法	reuters6165
	結構型商品	結構型商品所收本金						

其他金融商品							
--------	--	--	--	--	--	--	--

註：一、本表請填列適用財務會計準則第34號公報之金融商品。

二、金融商品應依帳列會計科目分別填列。

三、結構型商品，係指結合固定收益商品〈例如定期存款或債券〉與衍生性金融商品〈例如選擇權〉的組合型式商品交易。

四、評價調整及累計減損之金額，係指該類金融商品截至當季為止，期末帳列評價調整及累計減損之金額。

五、其他金融商品請自行填列商品名稱並應註明其性質。

六、衡量方法應說明該類金融商品係採用公平價值或攤銷後成本衡量。

七、公平價值產生之來源請說明係活絡市場之公開報價、參考最近市場之交易價格或參照其他實質上相同之商品當時市場價格、現金流量折現法或以評價技術估算等。

國內衍生性金融商品交易資訊
中華民國101年6月30日

單位:新台幣千元

項目	名目本金餘額	帳列之會計科目	帳列餘額	本期評價損益	採公平價值衡量者其公平價值產生之來源
利率有關契約	122,801,723	資產交換, 利率交換, 金融期貨, 選擇權, 遠期利率協定	-1,269,626	-73,500	選擇權以BSGK模型估算, 其餘採現金流量折現法
匯率有關契約	595,987,372	應收付遠匯款, 資產交換, 金融期貨, 選擇權, 換匯換利	575,031	-115,196	選擇權以BSGK模型估算, 其餘採現金流量折現法
權益證券有關契約		資產交換, 金融期貨, 選擇權			
商品有關契約		選擇權			
信用有關契約	19,589,085	選擇權, 信用違約交換	-727,741	-142,092	Bloomberg Counter Party網站
其他有關契約					

註:一、衍生性金融商品應依帳列會計科目分別填列。

二、本期評價損益係指衍生性金融商品於本年度截至當季為止, 期末依公平價值評價產生之評價損益。

三、公平價值產生之來源請說明細活絡市場之公開報價、參考最近市場之交易價格或參照其他實質上相同之商品當時市場價格、現金流量折現法或以評價技術估算等。

<二>國外金融商品交易資訊

投資國外金融商品交易資訊

中華民國101年6月30日

單位:新台幣千元

金融商品名稱		帳列之會計科目	原始投資成本	評價調整金額	累計減損金額	帳列餘額	衡量方法	採公平價值衡量者其公平價值產生之來源	國別
股票	上市櫃公司	交易目的					市價法	市價	
	上市櫃公司	指定衡量					市價法	市價	
	上市櫃公司	備供出售	12,660	115,457		128,117	市價法	市價	
	上市櫃公司	備供出售	358,430	-168,032		190,398	市價法	市價	百慕達
	非上市櫃公司	成本衡量	1,056,941		-324,953	731,988	市價法	市價	投資部
債券	政府債券	交易目的					市價法	市價	
	政府債券	指定衡量	598,157	29,953		628,110	市價法	市價	
	政府債券	備供出售	470,781	165		470,946	市價法	市價	
	政府債券	持至到期	2,291,634			2,291,634	持有至到期		
	政府債券	持至到期	380,126			380,126	持有至到期		日本
	金融債券	交易目的					現金流量折現法	bloomberg	
	金融債券	指定衡量	5,544,817	195,260		5,740,077	現金流量折現法	bloomberg	
	金融債券	指定衡量	448,605	4,549		453,154	現金流量折現法	bloomberg	美國
	金融債券	指定衡量	300,115	2,245		302,360	現金流量折現法	bloomberg	法國
	金融債券	指定衡量	448,618	-6,070		442,548	現金流量折現法	bloomberg	法國
	金融債券	指定衡量	632,413	39,257		671,670	現金流量折現法	bloomberg	瑞典
	金融債券	備供出售	19,216,806	-92,784		19,124,022	現金流量折現法	bloomberg	
	金融債券	備供出售	300,476	-15,069		285,407	現金流量折現法	bloomberg	美國
	金融債券	備供出售	448,268	22,566		470,834	現金流量折現法	bloomberg	荷蘭
	金融債券	備供出售	441,159	1,677		442,836	現金流量折現法	bloomberg	荷蘭
	金融債券	備供出售	358,855	-11,351		347,504	現金流量折現法	bloomberg	法國
	金融債券	備供出售	300,033	-2,838		297,195	現金流量折現法	bloomberg	法國
	金融債券	備供出售	300,476	192		300,668	現金流量折現法	bloomberg	英國
	金融債券	備供出售	360,571	-12,047		348,524	現金流量折現法	bloomberg	英國

金融債券	備供出售	450,714	-7,306		443,408	現金流量折現法	bloomberg	法國
金融債券	備供出售	327,721	2,900		330,621	現金流量折現法	bloomberg	美國
金融債券	備供出售	300,476	69		300,545	現金流量折現法	bloomberg	澳大利亞
金融債券	備供出售	598,140	347		598,487	現金流量折現法	bloomberg	澳大利亞
金融債券	備供出售	415,067	-9,541		405,526	現金流量折現法	bloomberg	美國
金融債券	備供出售	600,952	583		601,535	現金流量折現法	bloomberg	荷蘭
金融債券	備供出售	300,476	291		300,767	現金流量折現法	bloomberg	荷蘭
金融債券	備供出售	598,140			598,140	現金流量折現法	bloomberg	加拿大
金融債券	備供出售	897,210	-991		896,219	現金流量折現法	bloomberg	日本
金融債券	備供出售	448,605	-312		448,293	現金流量折現法	bloomberg	日本
金融債券	備供出售	598,140			598,140	現金流量折現法	bloomberg	加拿大
金融債券	備供出售	717,904	-136		717,768	現金流量折現法	bloomberg	日本
金融債券	備供出售	370,957	220		371,177	現金流量折現法	bloomberg	挪威
金融債券	持至到期	5,719,576			5,719,576	持有至到期		
金融債券	持至到期	447,898			447,898	持有至到期		中國大陸
金融債券	持至到期	302,842			302,842	持有至到期		英國
公司債	交易目的					現金流量折現法	bloomberg	
公司債	指定衡量	1,353,929	43,528		1,397,457	現金流量折現法	bloomberg	
公司債	指定衡量	448,605	-1,938		446,667	現金流量折現法	bloomberg	開曼群島
公司債	指定衡量	899,142	-8,982		890,160	現金流量折現法	bloomberg	法國
公司債	指定衡量	1,191,411	-7,692		1,183,719	現金流量折現法	bloomberg	美國
公司債	指定衡量	1,492,765	-4,891		1,487,874	現金流量折現法	bloomberg	韓國
公司債	備供出售	2,774,403	7,351		2,781,754	現金流量折現法	bloomberg	
公司債	備供出售	1,323,839	-4,096		1,319,743	現金流量折現法	bloomberg	韓國
公司債	備供出售	539,512	-3,933		535,579	現金流量折現法	bloomberg	法國
公司債	備供出售	1,893,464	-12,239		1,881,225	現金流量折現法	bloomberg	美國
公司債	備供出售	744,488	9,744		754,232	現金流量折現法	bloomberg	開曼群島
公司債	持至到期	515,161			515,161	持有至到期		
公司債	持至到期	517,351			517,351	持有至到期		英屬維爾京群島
公司債	持至到期	448,618			448,618	持有至到期		英國
其他債務商品	交易目的					現金流量折現法	reuters6165	
其他債務商品	指定衡量					現金流量折現法	reuters6165	
其他債務商品	備供出售	448,941	353		449,294	現金流量折現法	reuters6165	
其他債務商品	備供出售	300,810	2,034		302,844	現金流量折現法	reuters6165	德國

	其他債務商品	備供出售	300,625	-107		300,518	現金流量折現法	reuters6165	澳大利亞
	其他債務商品	備供出售	478,922	71		478,993	現金流量折現法	reuters6165	澳大利亞
	其他債務商品	備供出售	1,802,015	135		1,802,150	現金流量折現法	reuters6165	澳大利亞
	其他債務商品	備供出售	600,672	45		600,717	現金流量折現法	reuters6165	澳大利亞
	其他債務商品	備供出售	1,501,680	112		1,501,792	現金流量折現法	reuters6165	澳大利亞
	其他債務商品	備供出售	600,885	8		600,893	現金流量折現法	reuters6165	澳大利亞
	其他債務商品	持至到期					持有至到期		
其他	證券化商品	交易目的					現金流量折現法	bloomberg	
	證券化商品	指定衡量					現金流量折現法	bloomberg	
	證券化商品	備供出售	670,215	-107,523	-394,011	168,681	現金流量折現法	bloomberg	
	證券化商品	備供出售	322,996	-113,048	-206,717	3,231	現金流量折現法	bloomberg	美國
	證券化商品	持至到期					持有至到期		
	證券化商品	其他投資					現金流量折現法	bloomberg	
	結構型商品	結構型商品 所收本金							
	其他金融商品								

註：一、本表請填列適用財務會計準則第34號公報之金融商品。

二、單筆原始投資金額折合新台幣達3億元以上者，應單獨列示，並於註明該筆投資所屬之國家別。

三、結構型商品，係指結合固定收益商品〈例如定期存款或債券〉與衍生性金融商品〈例如選擇權〉的組合型式商品交易。

四、金融商品應依帳列會計科目分別填列。

五、評價調整及累計減損之金額，係指該類金融商品截至當季為止，期末帳列評價調整及累計減損之金額。

六、其他金融商品請自行填列商品名稱並應註明其性質。

七、衡量方法應說明該類金融商品係採用公平價值或攤銷後成本衡量。

八、公平價值產生之來源請說明係活絡市場之公開報價、參考最近市場之交易價格或參照其他實質上相同之商品當時市場價格、現金流量折現法或以評價技術估算等。

國外衍生性金融商品交易資訊
中華民國101年6月30日

單位:新台幣千元

項目	名日本金餘額	帳列之會計科目	帳列餘額	本期評價損益	採公平價值衡量者 其公平價值產生之 來源	國別
利率有關契約	3,525,696	資產交換,利率交換,金融期貨,選擇權,遠期利率協定	-163,726	18,330	選擇權以BSGK模型估算,其餘採現金流量折現法	
利率有關契約	448,605	資產交換,利率交換,金融期貨,選擇權,遠期利率協定	-7,678	-7,678	選擇權以BSGK模型估算,其餘採現金流量折現法	英國
匯率有關契約	12,001,214	應收付遠匯款,資產交換,金融期貨,選擇權,換匯換利	290,172	489,238	選擇權以BSGK模型估算,其餘採現金流量折現法	
匯率有關契約	1,405,629	應收付遠匯款,資產交換,金融期貨,選擇權,換匯換利	-44,968	-44,968	選擇權以BSGK模型估算,其餘採現金流量折現法	澳大利亞
匯率有關契約	523,373	應收付遠匯款,資產交換,金融期貨,選擇權,換匯換利	-15,496	-15,496	選擇權以BSGK模型估算,其餘採現金流量折現法	澳大利亞
匯率有關契約	448,605	應收付遠匯款,資產交換,金融期貨,選擇權,換匯換利	-3,258	-3,258	選擇權以BSGK模型估算,其餘採現金流量折現法	澳大利亞
匯率有關契約	897,210	應收付遠匯款,資產交換,金融期貨,選擇權,換匯換利	-23,973	-23,973	選擇權以BSGK模型估算,其餘採現金流量折現法	澳大利亞
匯率有關契約	897,210	應收付遠匯款,資產交換,金融期貨,選擇權,換匯換利	-11,469	-11,469	選擇權以BSGK模型估算,其餘採現金流量折現法	澳大利亞
匯率有關契約	578,202	應收付遠匯款,資產交換,金融期貨,選擇權,換匯換利	10	10	選擇權以BSGK模型估算,其餘採現金流量折現法	美國
匯率有關契約	693,954	應收付遠匯款,資產交換,金融期貨,選擇權,換匯換利	106	106	選擇權以BSGK模型估算,其餘採現金流量折現法	美國
匯率有關契約	771,076	應收付遠匯款,資產交換,金融期貨,選擇權,換匯換利	130	130	選擇權以BSGK模型估算,其餘採現金流量折現法	美國
匯率有關契約	501,100	應收付遠匯款,資產交換,金融期貨,選擇權,換匯換利	-24	-24	選擇權以BSGK模型估算,其餘採現金流量折現法	美國
匯率有關契約	687,861	應收付遠匯款,資產交換,金融期貨,選擇權,換匯換利	-195	-195	選擇權以BSGK模型估算,其餘採現金流量折現法	英國
匯率有關契約	478,512	應收付遠匯款,資產交換,金融期貨,選擇權,換匯換利	-5,493	-5,493	選擇權以BSGK模型估算,其餘採現金流量折現法	英國
匯率有關契約	385,463	應收付遠匯款,資產交換,金融期貨,選擇權,換匯換利	-17	-17	選擇權以BSGK模型估算,其餘採現金流量折現法	香港

匯率有關契約	375,595	應收付遠匯款, 資產交換, 金融期貨, 選擇權, 換匯換利	677	677	選擇權以BSGK模型估算, 其餘採現金流量折現法	英國
匯率有關契約	390,619	應收付遠匯款, 資產交換, 金融期貨, 選擇權, 換匯換利	25	25	選擇權以BSGK模型估算, 其餘採現金流量折現法	英國
匯率有關契約	360,571	應收付遠匯款, 資產交換, 金融期貨, 選擇權, 換匯換利	-5,628	-5,628	選擇權以BSGK模型估算, 其餘採現金流量折現法	英國
匯率有關契約	1,256,094	應收付遠匯款, 資產交換, 金融期貨, 選擇權, 換匯換利	-40,301	-40,301	選擇權以BSGK模型估算, 其餘採現金流量折現法	澳大利亞
匯率有關契約	1,495,350	應收付遠匯款, 資產交換, 金融期貨, 選擇權, 換匯換利	-33,126	-33,126	選擇權以BSGK模型估算, 其餘採現金流量折現法	澳大利亞
匯率有關契約	986,931	應收付遠匯款, 資產交換, 金融期貨, 選擇權, 換匯換利	-7,246	-7,246	選擇權以BSGK模型估算, 其餘採現金流量折現法	澳大利亞
匯率有關契約	1,794,420	應收付遠匯款, 資產交換, 金融期貨, 選擇權, 換匯換利	-9,116	-9,116	選擇權以BSGK模型估算, 其餘採現金流量折現法	澳大利亞
匯率有關契約	777,582	應收付遠匯款, 資產交換, 金融期貨, 選擇權, 換匯換利	-40,962	-40,962	選擇權以BSGK模型估算, 其餘採現金流量折現法	澳大利亞
匯率有關契約	986,931	應收付遠匯款, 資產交換, 金融期貨, 選擇權, 換匯換利	-30,608	-30,608	選擇權以BSGK模型估算, 其餘採現金流量折現法	澳大利亞
匯率有關契約	598,140	應收付遠匯款, 資產交換, 金融期貨, 選擇權, 換匯換利	-13,289	-13,289	選擇權以BSGK模型估算, 其餘採現金流量折現法	澳大利亞
匯率有關契約	1,495,350	應收付遠匯款, 資產交換, 金融期貨, 選擇權, 換匯換利	-10,529	-10,529	選擇權以BSGK模型估算, 其餘採現金流量折現法	澳大利亞
匯率有關契約	1,046,745	應收付遠匯款, 資產交換, 金融期貨, 選擇權, 換匯換利	-13,577	-13,577	選擇權以BSGK模型估算, 其餘採現金流量折現法	澳大利亞
匯率有關契約	744,744	應收付遠匯款, 資產交換, 金融期貨, 選擇權, 換匯換利	-11,386	-11,386	選擇權以BSGK模型估算, 其餘採現金流量折現法	英國
匯率有關契約	771,083	應收付遠匯款, 資產交換, 金融期貨, 選擇權, 換匯換利	135	135	選擇權以BSGK模型估算, 其餘採現金流量折現法	英國
匯率有關契約	771,021	應收付遠匯款, 資產交換, 金融期貨, 選擇權, 換匯換利	65	65	選擇權以BSGK模型估算, 其餘採現金流量折現法	英國
匯率有關契約	693,681	應收付遠匯款, 資產交換, 金融期貨, 選擇權, 換匯換利	-147	-147	選擇權以BSGK模型估算, 其餘採現金流量折現法	香港
匯率有關契約	345,547	應收付遠匯款, 資產交換, 金融期貨, 選擇權, 換匯換利	12,732	12,732	選擇權以BSGK模型估算, 其餘採現金流量折現法	瑞士
匯率有關契約	335,135	應收付遠匯款, 資產交換, 金融期貨, 選擇權, 換匯換利	-1,368	-1,368	選擇權以BSGK模型估算, 其餘採現金流量折現法	瑞士

匯率有關契約	358,884	應收付遠匯款, 資產交換, 金融期貨, 選擇權, 換匯換利	70	70	選擇權以BSGK模型估算, 其餘採現金流量折現法	瑞士
匯率有關契約	598,140	應收付遠匯款, 資產交換, 金融期貨, 選擇權, 換匯換利	-17,578	-17,578	選擇權以BSGK模型估算, 其餘採現金流量折現法	澳大利亞
匯率有關契約	1,076,652	應收付遠匯款, 資產交換, 金融期貨, 選擇權, 換匯換利	-32,221	-32,221	選擇權以BSGK模型估算, 其餘採現金流量折現法	澳大利亞
匯率有關契約	1,495,350	應收付遠匯款, 資產交換, 金融期貨, 選擇權, 換匯換利	-35,336	-35,336	選擇權以BSGK模型估算, 其餘採現金流量折現法	澳大利亞
匯率有關契約	1,286,001	應收付遠匯款, 資產交換, 金融期貨, 選擇權, 換匯換利	-21,152	-21,152	選擇權以BSGK模型估算, 其餘採現金流量折現法	澳大利亞
權益證券有關契約		資產交換, 金融期貨, 選擇權			選擇權以BSGK模型估算, 其餘採現金流量折現法	
商品有關契約		選擇權			選擇權以BSGK模型估算, 其餘採現金流量折現法	
信用有關契約		選擇權, 信用違約交換			Bloomberg Counter Party網站	
其他有關契約						

註:一、衍生性金融商品應依帳列會計科目分別填列。

二、單筆衍生性商品交易帳列餘額折合新台幣達3億元以上者, 應單獨列示, 並於註明該筆投資所屬之國家別。

三、本期評價損益係指衍生性金融商品於本年度截至當季為止, 期末依公平價值評價產生之評價損益。

四、公平價值產生之來源請說明係活絡市場之公開報價、參考最近市場之交易價格或參照其他實質上相同之商品當時市場價格、現金流量折現法或以評價技術估算等。