

附表1 銀行衍生性金融商品未結清契約名目本金餘額

103年12月底

單位：新臺幣百萬元；%

項 目	利率有關契約	匯率有關契約	權益證券有關契約	商品有關契約	信用有關契約	其他有關契約	合 計	比重
一、名目本金餘額	16,025,356	39,358,715	92,429	29,276	44,448	-	55,550,224	100.00
(一)店頭市場(OTC)	15,967,074	39,357,884	76,112	28,808	44,448	-	55,474,326	99.86
1.遠期契約(Forwards)	-	23,256,935	-	173	-	-	23,257,108	41.87
2.交換(Swaps)	15,428,186	1,960,781	45,458	11,678	44,448	-	17,490,551	31.48
3.買入選擇權(Bought Options)	209,467	7,032,465	13,947	8,508	-	-	7,264,387	13.08
4.賣出選擇權(Sold Options)	329,421	7,107,703	16,707	8,449	-	-	7,462,280	13.43
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	58,282	831	16,317	468	-	-	75,898	0.14
1.期貨-長部位(Futures-Long Positions)	11,391	155	1,906	233	-	-	13,685	0.02
2.期貨-短部位(Futures-Short Positions)	46,891	676	470	24	-	-	48,061	0.09
3.買入選擇權(Bought Options)	-	-	9,448	137	-	-	9,585	0.02
4.賣出選擇權(Sold Options)	-	-	4,493	74	-	-	4,567	0.01
二、名目本金餘額	16,025,356	39,358,715	92,429	29,276	44,448	-	55,550,224	100.00
(一)交易目的之契約總額	15,843,757	39,295,803	92,429	29,276	44,448	-	55,305,713	99.56
(二)非交易目的之契約總額	181,599	62,912	-	-	-	-	244,511	0.44

註： 本表資料包括本國銀行(總行、國內外分行及國際金融業務分行)及外國銀行(在台一般分行及國際金融業務分行)。

附表2 銀行衍生性金融商品未結清契約名目本金餘額比較

單位：新臺幣百萬元；%

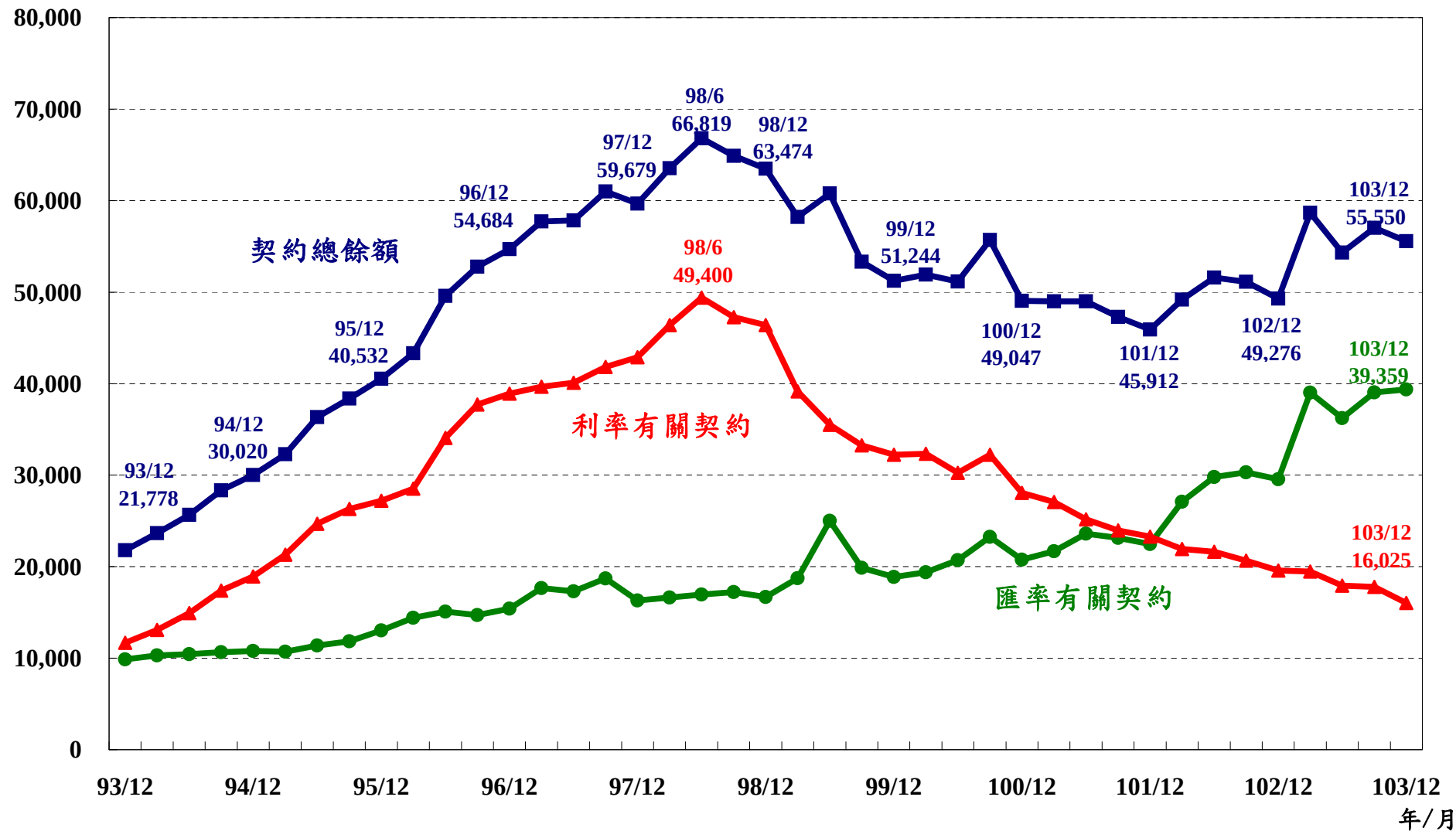
項 目	103年12月底		103年9月底		比 較 增 減	
	金額	比重	金額	比重	金額	變動率
一、名目本金餘額	55,550,224	100.00	56,992,547	100.00	-1,442,323	-2.53
(一)店頭市場(OTC)	55,474,326	99.86	56,880,331	99.80	-1,406,005	-2.47
1.遠期契約(Forwards)	23,257,108	41.87	21,804,807	38.26	1,452,301	6.66
2.交換(Swaps)	17,490,551	31.48	19,269,959	33.81	-1,779,408	-9.23
3.買入選擇權(Bought Options)	7,264,387	13.08	7,799,000	13.68	-534,613	-6.85
4.賣出選擇權(Sold Options)	7,462,280	13.43	8,006,565	14.05	-544,285	-6.80
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	75,898	0.14	112,216	0.20	-36,318	-32.36
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	13,685	0.02	21,469	0.04	-7,784	-36.26
2.期貨-短部位(Futures -Short Positions)	48,061	0.09	43,613	0.08	4,448	10.20
3.買入選擇權(Bought Options)	9,585	0.02	12,614	0.02	-3,029	-24.01
4.賣出選擇權(Sold Options)	4,567	0.01	34,520	0.06	-29,953	-86.77
二、名目本金餘額	55,550,224	100.00	56,992,547	100.00	-1,442,323	-2.53
(一)交易目的之契約總額	55,305,713	99.56	56,702,815	99.49	-1,397,102	-2.46
(二)非交易目的之契約總額	244,511	0.44	289,732	0.51	-45,221	-15.61

註： 本表資料包括本國銀行(總行、國內外分行及國際金融業務分行)及外國銀行(一般分行及國際金融業務分行)。

附圖1 銀行辦理衍生性金融商品未結清契約統計

新臺幣10億元

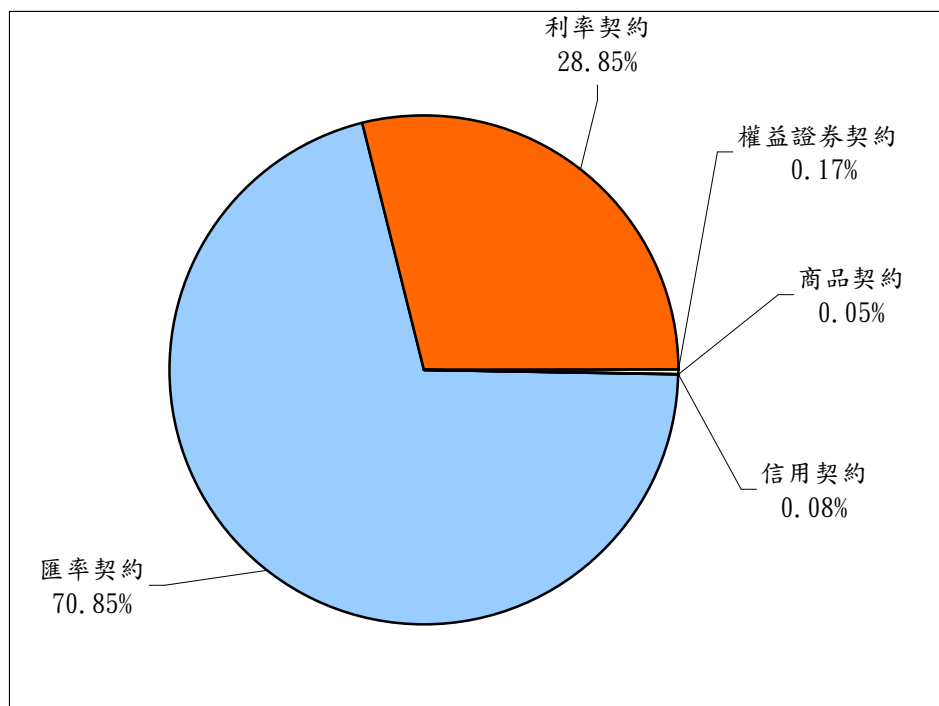
103年12月底



附圖2 銀行衍生性金融商品未結清契約內容分析

103年12月底

風險類別



銀行類別

