

附表1 銀行衍生性金融商品未結清契約名目本金餘額

104年6月底
市 場 別

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、店頭市場(OTC)	14,708,029	40,575,033	44,628	33,745	39,944	-	55,401,379	99.85
(一)遠期契約(Forwards)	71,472	23,330,981	-	63	-	-	23,402,516	42.18
(二)交換(Swaps)	14,135,150	2,118,324	30,139	13,495	39,944	-	16,337,052	29.44
(三)買入選擇權(Bought Options)	183,813	7,545,509	5,481	10,132	-	-	7,744,935	13.96
(四)賣出選擇權(Sold Options)	317,594	7,580,219	9,008	10,055	-	-	7,916,876	14.27
二、交易所(Exchange-traded Contracts)	63,254	2,203	16,696	100	-	-	82,253	0.15
(一)期貨-長部位(Futures-Long Positions)	4,821	547	908	42	-	-	6,318	0.01
(二)期貨-短部位(Futures-Short Positions)	58,433	1,656	348	27	-	-	60,464	0.11
(三)買入選擇權(Bought Options)	-	-	6,664	7	-	-	6,671	0.01
(四)賣出選擇權(Sold Options)	-	-	8,776	24	-	-	8,800	0.02
合 計	14,771,283	40,577,236	61,324	33,845	39,944	-	55,483,632	100.00

目 的 別

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、交易目的	14,593,570	40,515,635	61,324	33,845	39,944	-	55,244,318	99.57
二、非交易目的	177,713	61,601	-	-	-	-	239,314	0.43
合 計	14,771,283	40,577,236	61,324	33,845	39,944	-	55,483,632	100.00

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；%

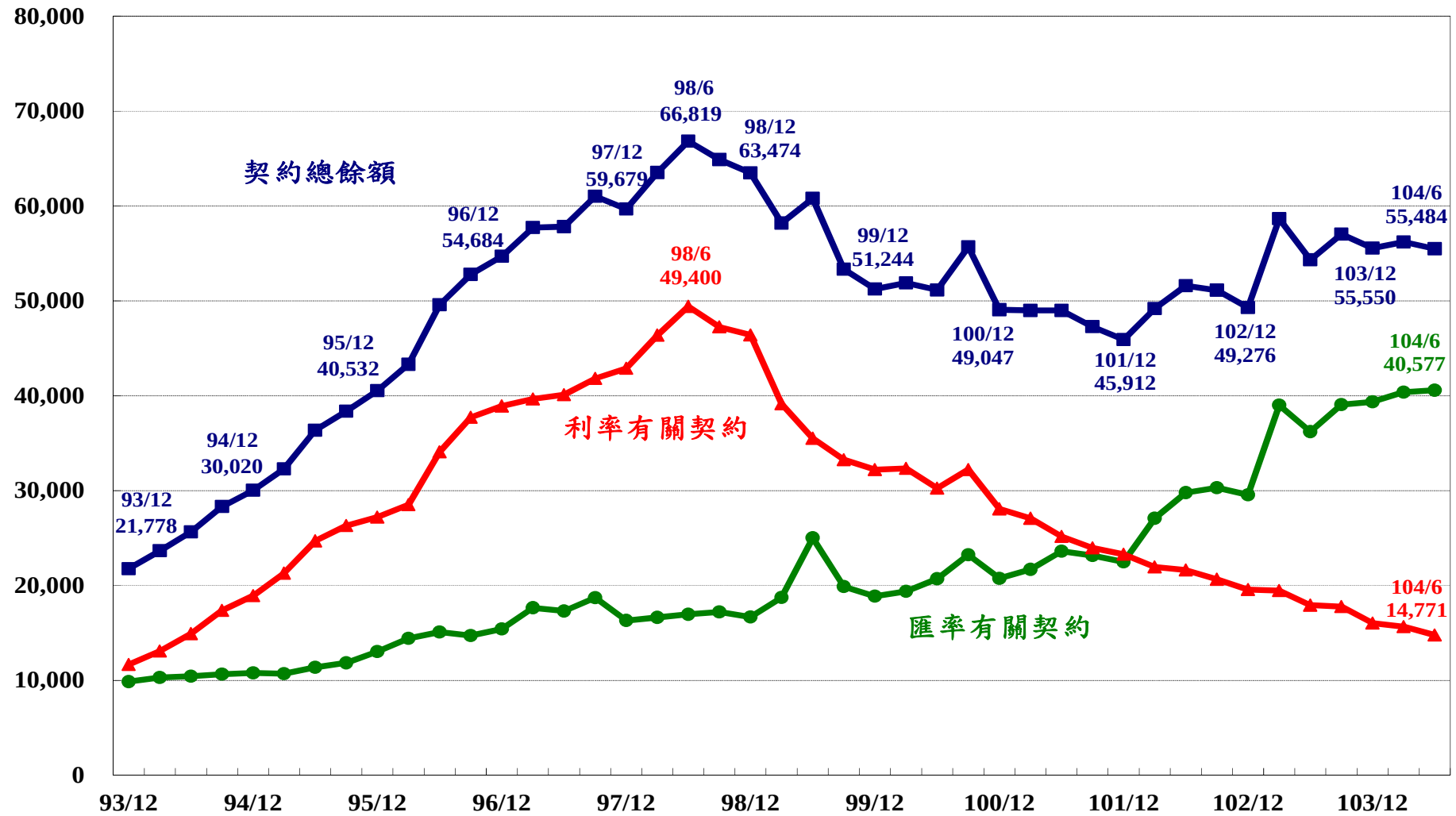
項 目	104年6月底		104年3月底		比較增減	
	金額	比重	金額	比重	金額	變動率
一、店頭市場(OTC)	55,401,379	99.85	56,114,764	99.84	-713,385	-1.27
（一）遠期契約(Forwards)	23,402,516	42.18	23,728,200	42.22	-325,684	-1.37
（二）交換(Swaps)	16,337,052	29.44	17,376,365	30.92	-1,039,313	-5.98
（三）買入選擇權(Bought Options)	7,744,935	13.96	7,428,247	13.21	316,688	4.26
（四）賣出選擇權(Sold Options)	7,916,876	14.27	7,581,952	13.49	334,924	4.42
二、交易所(Exchange-traded Contracts)	82,253	0.15	89,691	0.16	-7,438	-8.29
（一）期貨-長部位(Futures-Long Positions)	6,318	0.01	13,645	0.03	-7,327	-53.70
（二）期貨-短部位(Futures-Short Positions)	60,464	0.11	55,821	0.10	4,643	8.32
（三）買入選擇權(Bought Options)	6,671	0.01	13,190	0.02	-6,519	-49.42
（四）賣出選擇權(Sold Options)	8,800	0.02	7,035	0.01	1,765	25.09
合 計	55,483,632	100.00	56,204,455	100.00	-720,823	-1.28

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

104年6月底

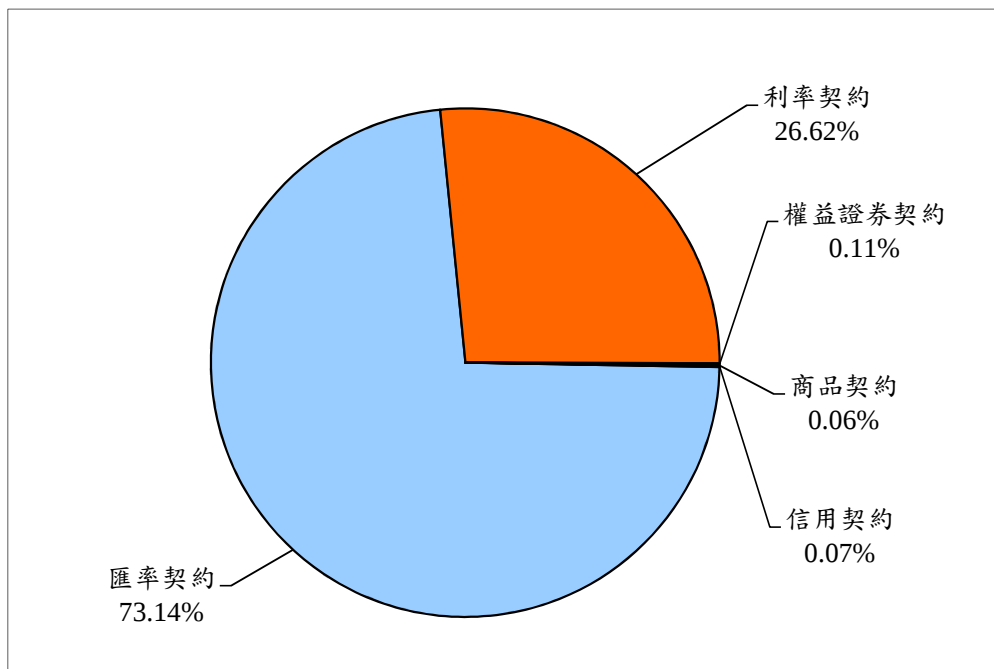


年/月

附圖2 銀行衍生性金融商品未結清契約內容分析

104年6月底

風險類別



銀行類別

