

附表1 銀行衍生性金融商品未結清契約名目本金餘額

107年12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)	19,753,983	39,392,736	16,034	5,861	54,798	-	59,223,412	99.13
(一)遠期契約(Forwards)	-	36,292,565	-	121	-	-	36,292,686	60.75
(二)交換(Swaps)	18,335,787	1,936,309	9,529	2,465	54,798	-	20,338,888	34.04
(三)買入選擇權(Bought Options)	213,694	588,212	2,924	1,641	-	-	806,471	1.35
(四)賣出選擇權(Sold Options)	1,204,502	575,650	3,581	1,634	-	-	1,785,367	2.99
二、交易所(Exchange-traded Contracts)	485,019	23,350	10,403	294	-	-	519,066	0.87
(一)期貨-長部位(Futures-Long Positions)	114,378	7,684	245	140	-	-	122,447	0.20
(二)期貨-短部位(Futures-Short Positions)	370,641	10,152	942	137	-	-	381,872	0.64
(三)買入選擇權(Bought Options)	-	2,936	1,937	-	-	-	4,873	0.01
(四)賣出選擇權(Sold Options)	-	2,578	7,279	17	-	-	9,874	0.02
合 計	20,239,002	39,416,086	26,437	6,155	54,798	-	59,742,478	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	20,028,947	39,244,546	26,437	6,155	54,798	-	59,360,883	99.36
二、非交易目的	210,055	171,540	-	-	-	-	381,595	0.64
合 計	20,239,002	39,416,086	26,437	6,155	54,798	-	59,742,478	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)及外國與大陸地區銀行(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；%

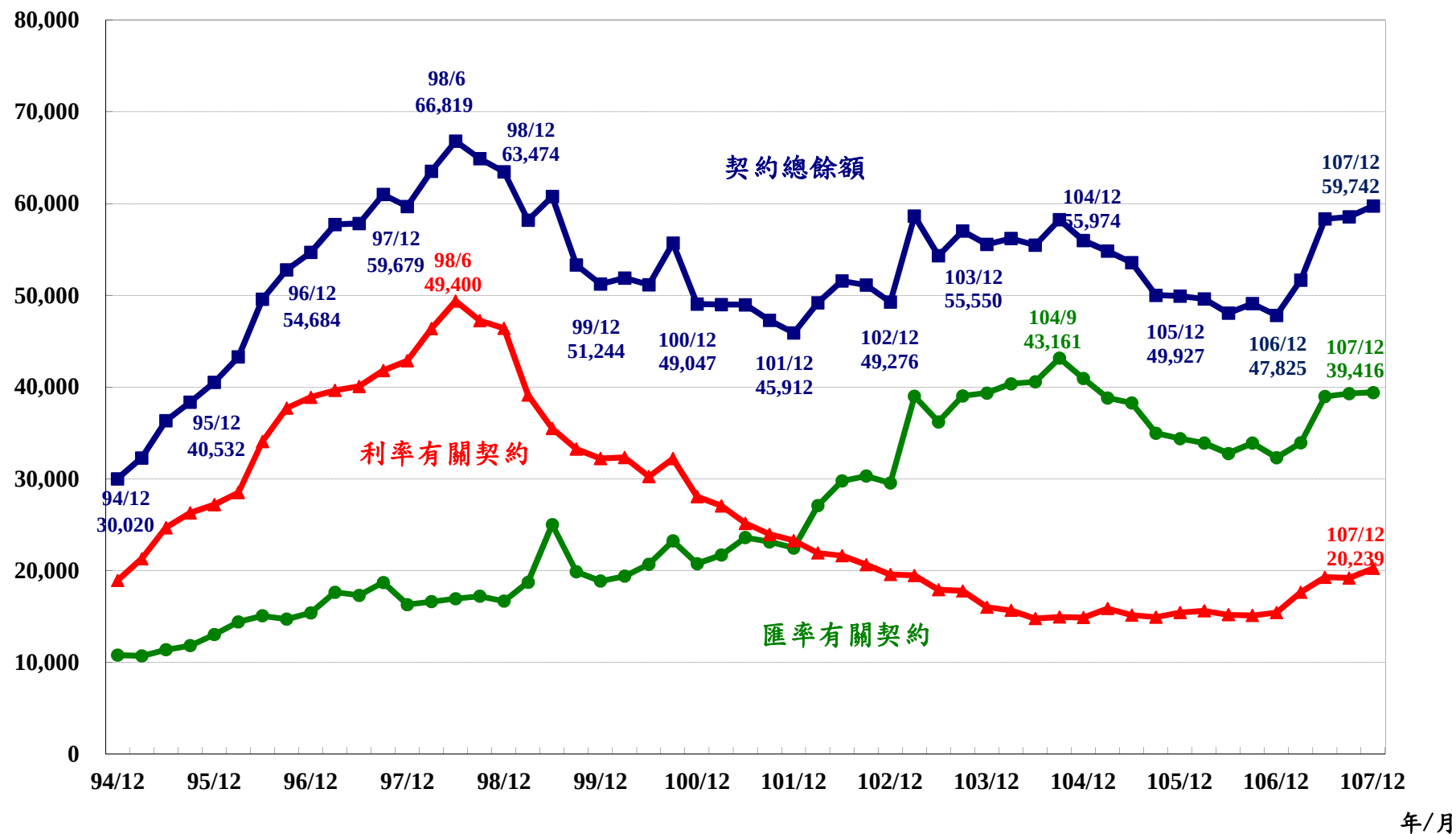
項 目	107年12月底		107年9月底		比較增減	
	金額	比重	金額	比重	金額	變動率
一、店頭市場(OTC)	59,223,412	99.13	58,160,748	99.31	1,062,664	1.83
(一)遠期契約(Forwards)	36,292,686	60.75	35,723,555	60.99	569,131	1.59
(二)交換(Swaps)	20,338,888	34.04	19,351,097	33.04	987,791	5.10
(三)買入選擇權(Bought Options)	806,471	1.35	1,082,449	1.86	-275,978	-25.50
(四)賣出選擇權(Sold Options)	1,785,367	2.99	2,003,647	3.42	-218,280	-10.89
二、交易所(Exchange-traded Contracts)	519,066	0.87	411,120	0.69	107,946	26.26
(一)期貨-長部位(Futures-Long Positions)	122,447	0.20	195,657	0.33	-73,210	-37.42
(二)期貨-短部位(Futures-Short Positions)	381,872	0.64	198,397	0.34	183,475	92.48
(三)買入選擇權(Bought Options)	4,873	0.01	8,748	0.01	-3,875	-44.30
(四)賣出選擇權(Sold Options)	9,874	0.02	8,318	0.01	1,556	18.71
合 計	59,742,478	100.00	58,571,868	100.00	1,170,610	2.00

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)及外國與大陸地區銀行(一般分行及國際金融業務分行)。

附圖1 銀行衍生性金融商品未結清契約統計

新臺幣10億元

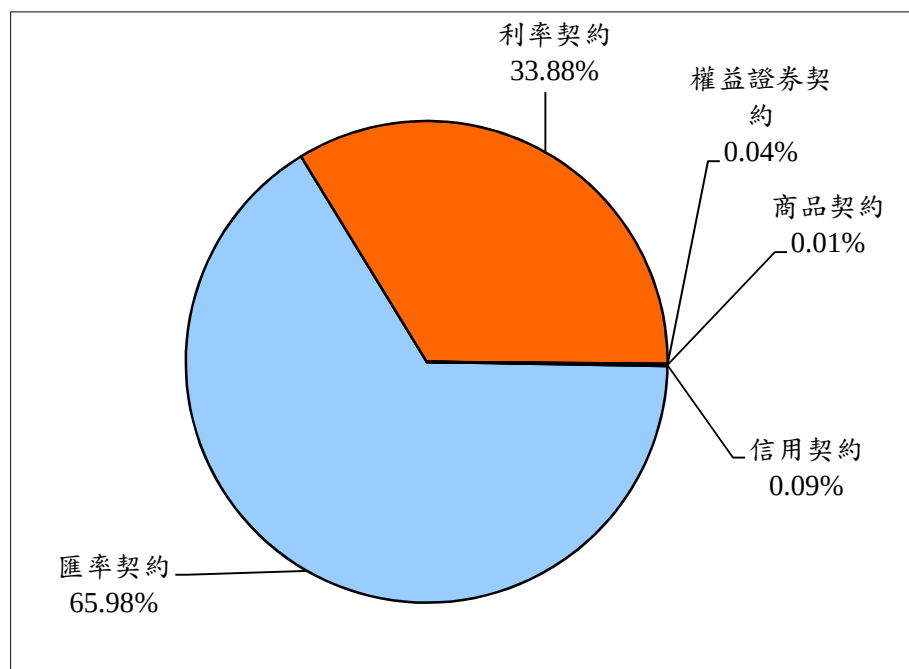
107年12月底



附圖2 銀行衍生性金融商品未結清契約內容分析

107年12月底

風險類別



銀行類別

