

附表1 銀行衍生性金融商品餘額季報表

101年6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	25,166,927	23,613,780	30,942	79,750	91,066	-	48,982,465	100.00
(一)店頭市場(OTC)	25,093,560	23,613,780	21,998	79,516	91,066	-	48,899,920	99.83
1.遠期契約(Forwards)	14,907	16,799,782	-	1,040	-	-	16,815,729	34.33
2.交換(Swaps)	23,638,117	2,439,093	8,192	14,987	89,566	-	26,189,955	53.47
3.買入選擇權(Bought Options)	692,874	2,153,205	5,153	31,309	1,500	-	2,884,041	5.89
4.賣出選擇權(Sold Options)	747,662	2,221,700	8,653	32,180	-	-	3,010,195	6.14
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	73,367	-	8,944	234	-	-	82,545	0.17
1.期貨-長部位(Futures-Long Positions)	6,613	-	191	124	-	-	6,928	0.01
2.期貨-短部位(Futures-Short Positions)	66,754	-	2,143	10	-	-	68,907	0.14
3.買入選擇權(Bought Options)	-	-	3,472	35	-	-	3,507	0.01
4.賣出選擇權(Sold Options)	-	-	3,138	65	-	-	3,203	0.01
二、名目本金餘額	25,166,927	23,613,780	30,942	79,750	91,066	-	48,982,465	100.00
(一)交易目的之契約總額	24,875,758	23,585,345	30,942	79,750	90,980	-	48,662,775	99.35
(二)非交易目的之契約總額	291,169	28,435	-	-	86	-	319,690	0.65

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名目本金餘額季報比較表

101年6月底

單位：新臺幣百萬元；%

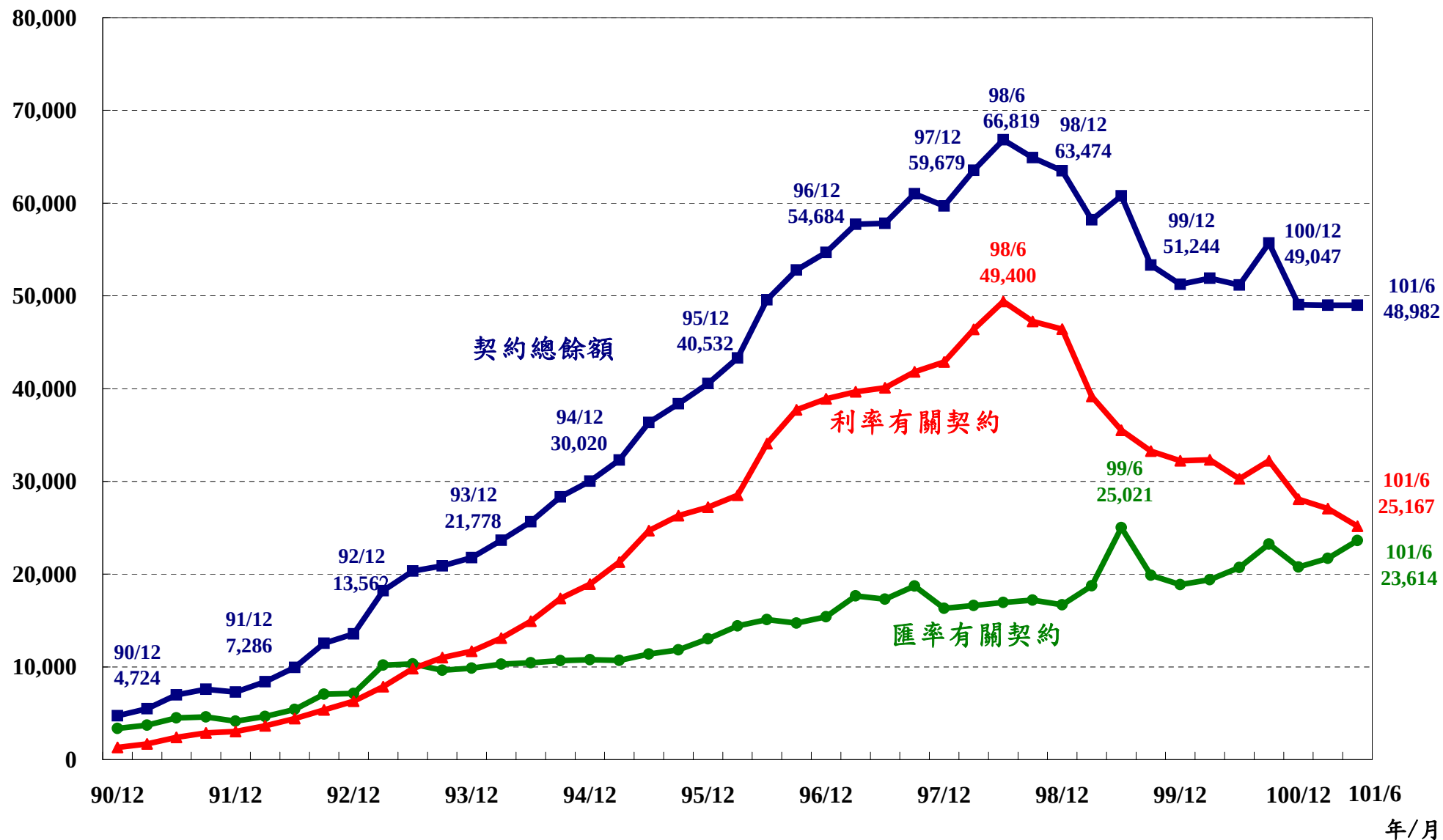
項 目	101年6月底		101年3月底		比 較 增 減	
	金額	比重	金額	比重	金額	變動率
一、名目本金餘額	48,982,465	100.00	48,993,187	100.00	-10,722	-0.02
(一)店頭市場(OTC)	48,899,920	99.83	48,911,330	99.83	-11,410	-0.02
1.遠期契約(Forwards)	16,815,729	34.33	15,747,625	32.14	1,068,104	6.78
2.交換(Swaps)	26,189,955	53.47	27,919,947	56.99	-1,729,992	-6.20
3.買入選擇權(Bought Options)	2,884,041	5.89	2,553,150	5.21	330,891	12.96
4.賣出選擇權(Sold Options)	3,010,195	6.14	2,690,608	5.49	319,587	11.88
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	82,545	0.17	81,857	0.17	688	0.84
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	6,928	0.01	2,546	0.01	4,382	172.11
2.期貨-短部位(Futures -Short Positions)	68,907	0.14	68,933	0.14	-26	-0.04
3.買入選擇權(Bought Options)	3,507	0.01	6,764	0.01	-3,257	-48.15
4.賣出選擇權(Sold Options)	3,203	0.01	3,614	0.01	-411	-11.37
二、名目本金餘額	48,982,465	100.00	48,993,187	100.00	-10,722	-0.02
(一)交易目的之契約總額	48,662,775	99.35	48,678,237	99.36	-15,462	-0.03
(二)非交易目的之契約總額	319,690	0.65	314,950	0.64	4,740	1.51

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

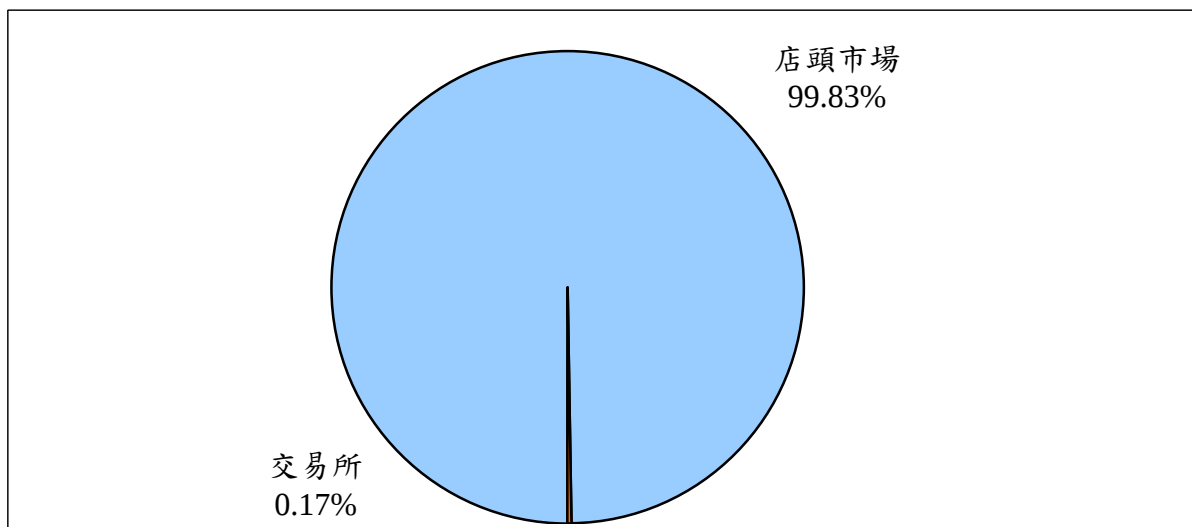
新臺幣10億元

101年6月底

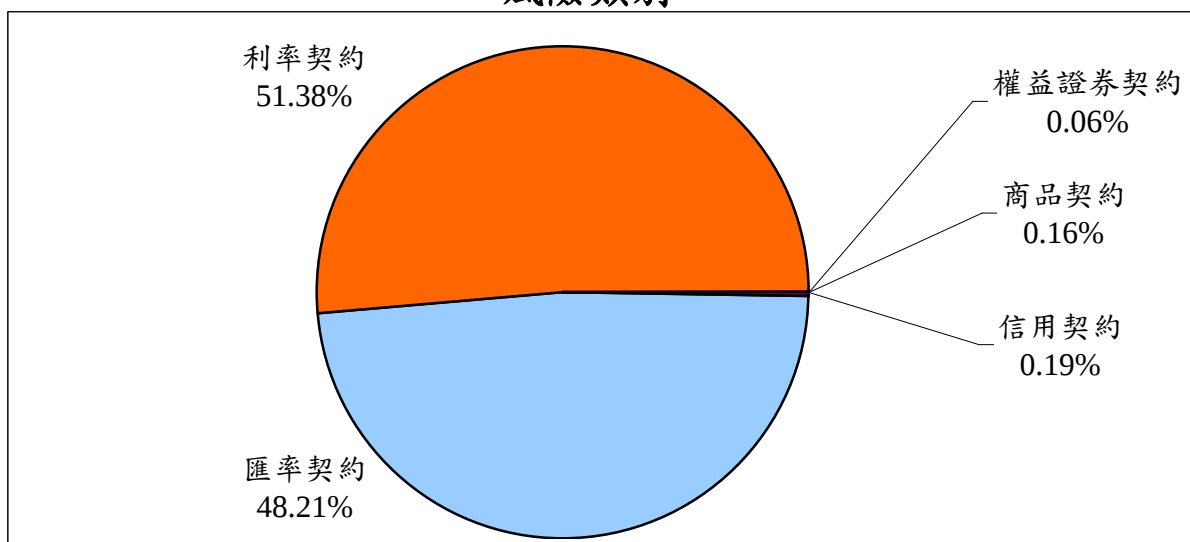


附圖2 銀行衍生性金融商品未結清契約內容分析

101年6月底
市場類別



風險類別



銀行類別

