

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3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)	17,290,245	33,915,224	20,711	8,393	45,696	-	51,280,269	99.25
(一)遠期契約(Forwards)	-	30,899,917	-	-	-	-	30,899,917	59.80
(二)交換(Swaps)	16,058,064	1,498,459	11,584	5,218	45,696	-	17,619,021	34.10
(三)買入選擇權(Bought Options)	211,244	763,408	4,314	1,208	-	-	980,174	1.90
(四)賣出選擇權(Sold Options)	1,020,937	753,440	4,813	1,967	-	-	1,781,157	3.45
二、交易所(Exchange-traded Contracts)	353,603	26,239	12,589	385	-	-	392,816	0.75
(一)期貨-長部位(Futures-Long Positions)	149,374	4,846	1,066	177	-	-	155,463	0.30
(二)期貨-短部位(Futures-Short Positions)	203,425	10,138	1,518	141	-	-	215,222	0.41
(三)買入選擇權(Bought Options)	804	6,559	3,546	12	-	-	10,921	0.02
(四)賣出選擇權(Sold Options)	-	4,696	6,459	55	-	-	11,210	0.02
合 計	17,643,848	33,941,463	33,300	8,778	45,696	-	51,673,085	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	17,450,279	33,870,099	33,300	8,778	45,696	-	51,408,152	99.49
二、非交易目的	193,569	71,364	-	-	-	-	264,933	0.51
合 計	17,643,848	33,941,463	33,300	8,778	45,696	-	51,673,085	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；%

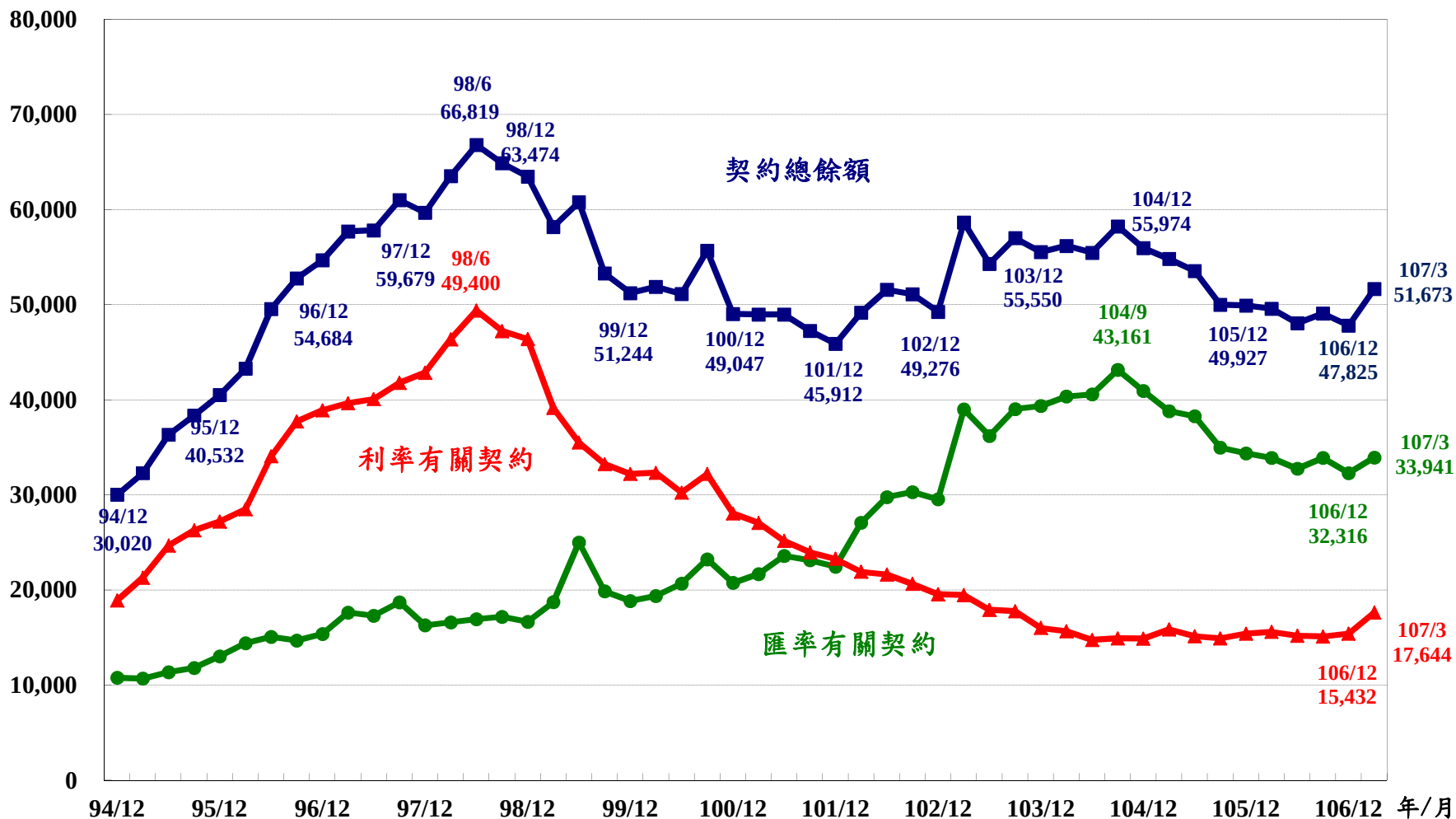
項 目	107年3月底		106年12月底		比較增減	
	金額	比重	金額	比重	金額	變動率
一、店頭市場(OTC)	51,280,269	99.25	47,600,716	99.53	3,679,553	7.73
(一)遠期契約(Forwards)	30,899,917	59.80	29,312,508	61.29	1,587,409	5.42
(二)交換(Swaps)	17,619,021	34.10	16,251,262	33.98	1,367,759	8.42
(三)買入選擇權(Bought Options)	980,174	1.90	794,559	1.66	185,615	23.36
(四)賣出選擇權(Sold Options)	1,781,157	3.45	1,242,387	2.60	538,770	43.37
二、交易所(Exchange-traded Contracts)	392,816	0.75	223,789	0.47	169,027	75.53
(一)期貨-長部位(Futures-Long Positions)	155,463	0.30	40,979	0.09	114,484	279.37
(二)期貨-短部位(Futures-Short Positions)	215,222	0.41	159,337	0.32	55,885	35.07
(三)買入選擇權(Bought Options)	10,921	0.02	10,842	0.02	79	0.73
(四)賣出選擇權(Sold Options)	11,210	0.02	12,631	0.04	-1,421	-11.25
合 計	51,673,085	100.00	47,824,505	100.00	3,848,580	8.05

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

107年3月底

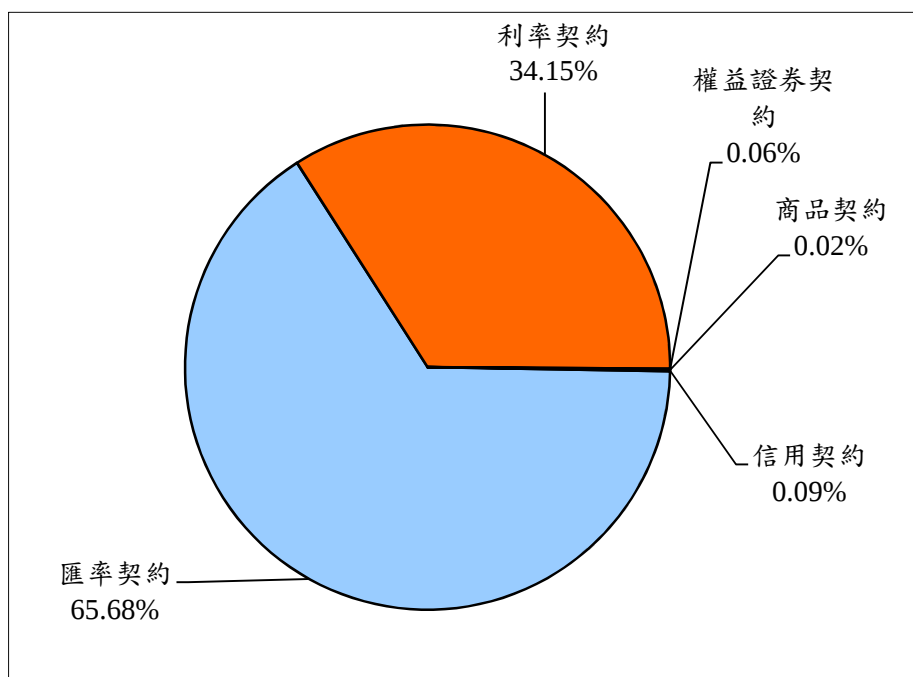
新臺幣10億元



附圖2 銀行衍生性金融商品未結清契約內容分析

107年3月底

風險類別



銀行類別

