

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3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	15,673,229	40,368,918	70,349	46,795	45,164	-	56,204,455	100.00
(一)店頭市場(OTC)	15,608,205	40,367,119	49,388	44,888	45,164	-	56,114,764	99.84
1.遠期契約(Forwards)	40,823	23,687,205	-	172	-	-	23,728,200	42.22
2.交換(Swaps)	15,009,692	2,280,027	29,431	12,051	45,164	-	17,376,365	30.92
3.買入選擇權(Bought Options)	208,880	7,194,701	8,374	16,292	-	-	7,428,247	13.21
4.賣出選擇權(Sold Options)	348,810	7,205,186	11,583	16,373	-	-	7,581,952	13.49
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	65,024	1,799	20,961	1,907	-	-	89,691	0.16
1.期貨-長部位(Futures-Long Positions)	11,825	744	271	805	-	-	13,645	0.03
2.期貨-短部位(Futures-Short Positions)	53,199	1,055	745	822	-	-	55,821	0.10
3.買入選擇權(Bought Options)	-	-	13,056	134	-	-	13,190	0.02
4.賣出選擇權(Sold Options)	-	-	6,889	146	-	-	7,035	0.01
二、名目本金餘額	15,673,229	40,368,918	70,349	46,795	45,164	-	56,204,455	100.00
(一)交易目的之契約總額	15,489,272	40,309,615	70,349	46,795	45,164	-	55,961,195	99.57
(二)非交易目的之契約總額	183,957	59,303	-	-	-	-	243,260	0.43

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；%

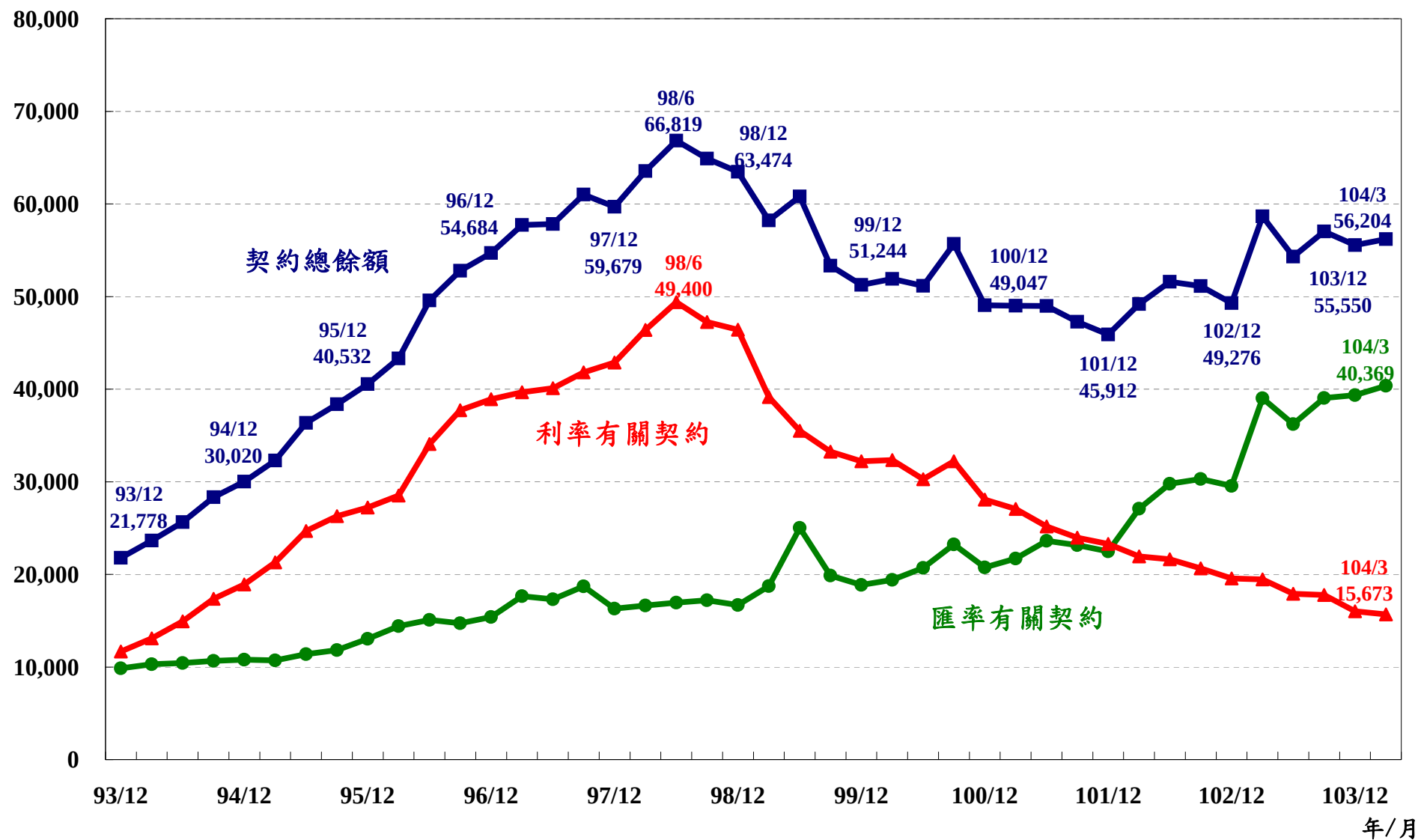
項 目	104年3月底		103年12月底		比 較 增 減	
	金額	比重	金額	比重	金額	變動率
一、名目本金餘額	56,204,455	100.00	55,550,224	100.00	654,231	1.18
(一)店頭市場(OTC)	56,114,764	99.84	55,474,326	99.86	640,438	1.15
1.遠期契約(Forwards)	23,728,200	42.22	23,257,108	41.87	471,092	2.03
2.交換(Swaps)	17,376,365	30.92	17,490,551	31.48	-114,186	-0.65
3.買入選擇權(Bought Options)	7,428,247	13.21	7,264,387	13.08	163,860	2.26
4.賣出選擇權(Sold Options)	7,581,952	13.49	7,462,280	13.43	119,672	1.60
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	89,691	0.16	75,898	0.14	13,793	18.17
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	13,645	0.03	13,685	0.02	-40	-0.29
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	55,821	0.10	48,061	0.09	7,760	16.15
3.買入選擇權(Bought Options)	13,190	0.02	9,585	0.02	3,605	37.61
4.賣出選擇權(Sold Options)	7,035	0.01	4,567	0.01	2,468	54.04
二、名目本金餘額	56,204,455	100.00	55,550,224	100.00	654,231	1.18
(一)交易目的之契約總額	55,961,195	99.57	55,305,713	99.56	655,482	1.19
(二)非交易目的之契約總額	243,260	0.43	244,511	0.44	-1,251	-0.51

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

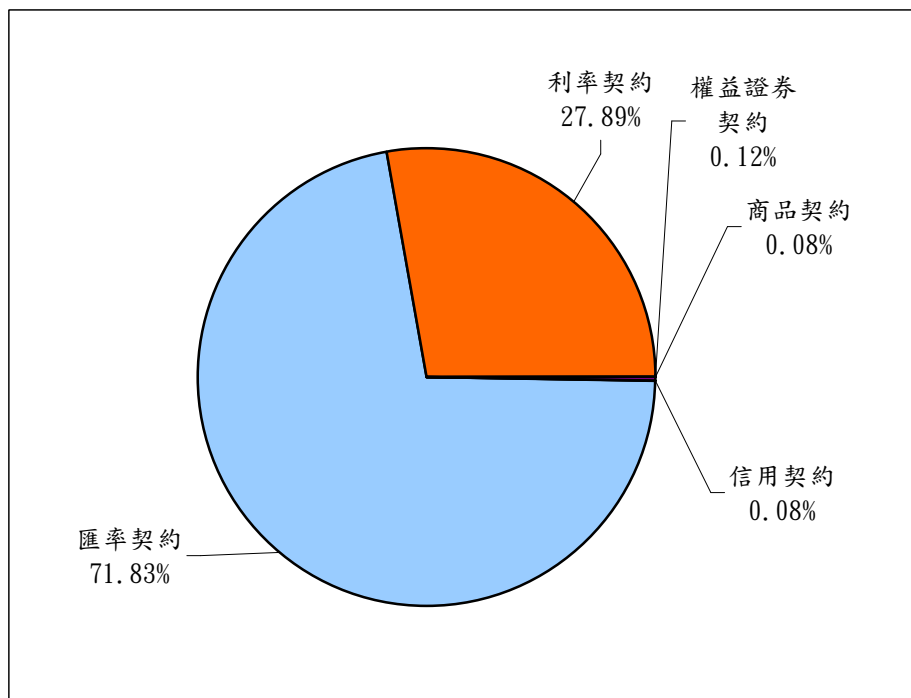
104年3月底



附圖2 銀行衍生性金融商品未結清契約內容分析

104年3月底

風險類別



銀行類別

