

附表1 銀行衍生性金融商品未結清契約名目本金餘額季報表

102年12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	19,566,817	29,547,505	79,893	32,363	49,792	-	49,276,370	100.00
(一)店頭市場(OTC)	19,492,525	29,547,505	47,328	32,148	49,792	-	49,169,298	99.78
1.遠期契約(Forwards)	1,072	18,762,047	-	876	-	-	18,763,995	38.08
2.交換(Swaps)	18,844,755	2,257,966	32,109	13,044	49,792	-	21,197,666	43.02
3.買入選擇權(Bought Options)	293,289	4,222,289	7,126	9,225	-	-	4,531,929	9.19
4.賣出選擇權(Sold Options)	353,409	4,305,203	8,093	9,003	-	-	4,675,708	9.49
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	74,292	-	32,565	215	-	-	107,072	0.22
1.期貨-長部位(Futures-Long Positions)	19,900	-	3,512	11	-	-	23,423	0.05
2.期貨-短部位(Futures-Short Positions)	54,392	-	1,139	92	-	-	55,623	0.11
3.買入選擇權(Bought Options)	-	-	13,489	16	-	-	13,505	0.03
4.賣出選擇權(Sold Options)	-	-	14,425	96	-	-	14,521	0.03
二、名目本金餘額	19,566,817	29,547,505	79,893	32,363	49,792	-	49,276,370	100.00
(一)交易目的之契約總額	19,305,032	29,515,448	79,728	32,363	49,706	-	48,982,277	99.40
(二)非交易目的之契約總額	261,785	32,057	165	-	86	-	294,093	0.60

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季報比較表

102年12月底

單位：新臺幣百萬元；%

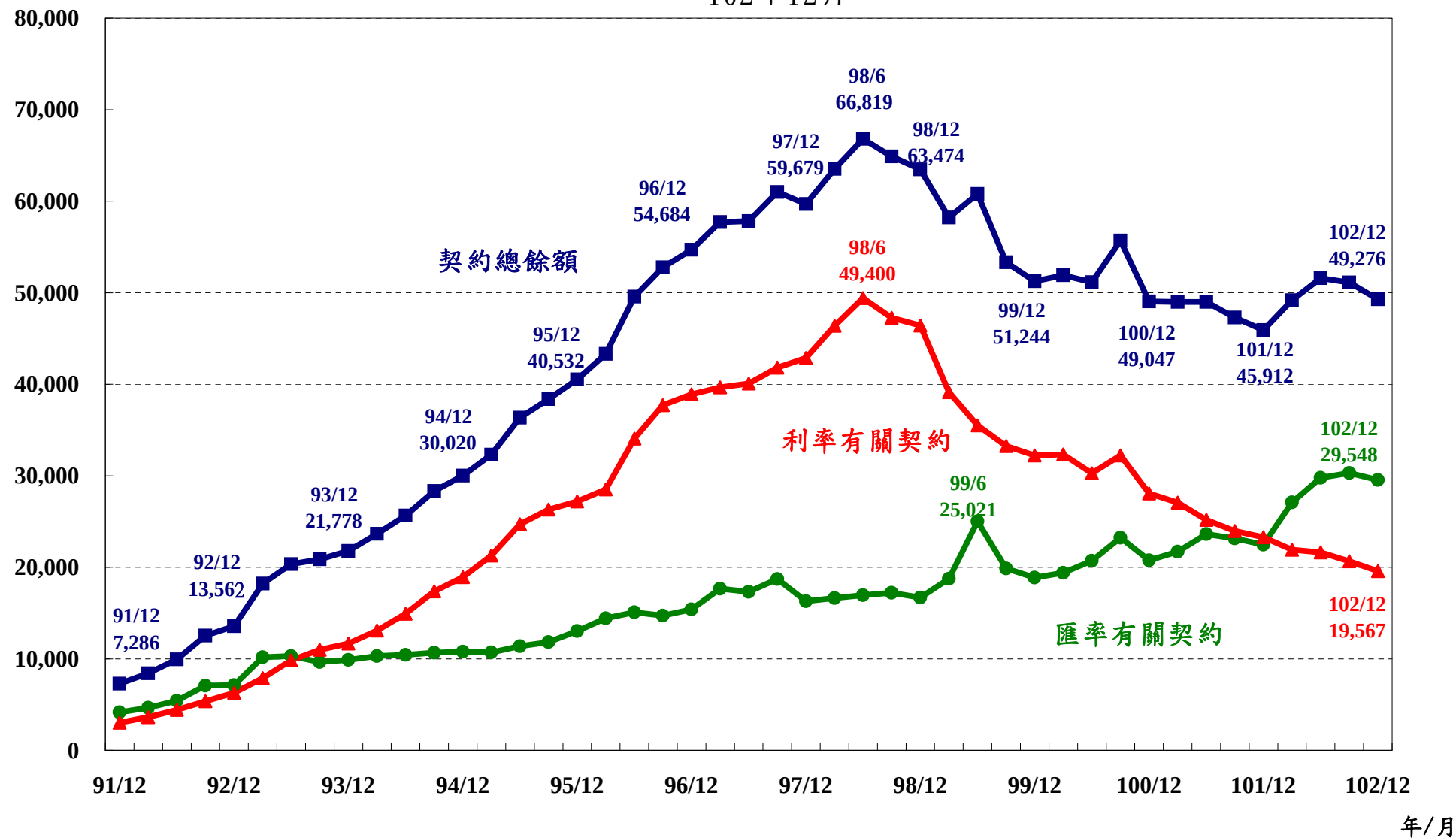
項 目	102年12月底		102年9月底		比 較 增 減	
	金額	比重	金額	比重	金額	變動率
一、名目本金餘額	49,276,370	100.00	51,121,457	100.00	-1,845,087	-3.61
(一)店頭市場(OTC)	49,169,298	99.78	51,041,097	99.84	-1,871,799	-3.67
1.遠期契約(Forwards)	18,763,995	38.08	17,875,428	34.96	888,567	4.97
2.交換(Swaps)	21,197,666	43.02	22,709,628	44.42	-1,511,962	-6.66
3.買入選擇權(Bought Options)	4,531,929	9.19	5,202,354	10.18	-670,425	-12.89
4.賣出選擇權(Sold Options)	4,675,708	9.49	5,253,687	10.28	-577,979	-11.00
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	107,072	0.22	80,360	0.16	26,712	33.24
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	23,423	0.05	12,871	0.02	10,552	81.98
2.期貨-短部位(Futures -Short Positions)	55,623	0.11	49,244	0.10	6,379	12.95
3.買入選擇權(Bought Options)	13,505	0.03	9,127	0.02	4,378	47.97
4.賣出選擇權(Sold Options)	14,521	0.03	9,118	0.02	5,403	59.26
二、名目本金餘額	49,276,370	100.00	51,121,457	100.00	-1,845,087	-3.61
(一)交易目的之契約總額	48,982,277	99.40	50,824,521	99.42	-1,842,244	-3.62
(二)非交易目的之契約總額	294,093	0.60	296,936	0.58	-2,843	-0.96

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

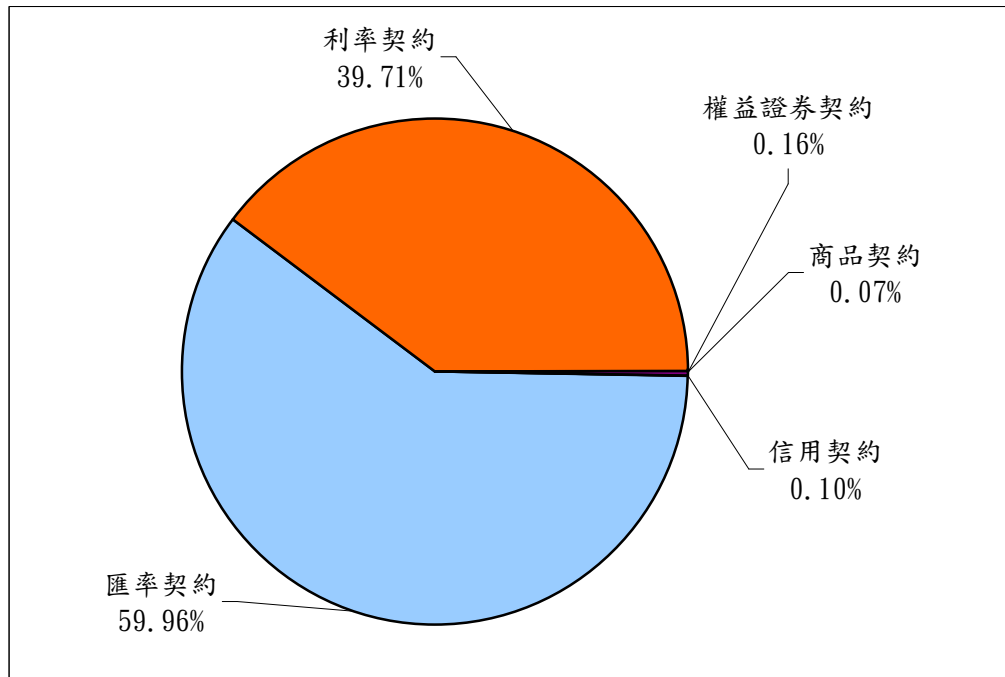
102年12月



附圖2 銀行衍生性金融商品未結清契約內容分析

102年12月底

風險類別



銀行類別

