

# 附表1 銀行衍生性金融商品餘額季報表

101年3月底

單位：新臺

| 項 目                                | 利率有關契約            | 匯率有關契約            | 權益證券有<br>關契約  | 商品有關契約         | 信用有關契約        | 其他有關契約   | 合 計               |
|------------------------------------|-------------------|-------------------|---------------|----------------|---------------|----------|-------------------|
| <b>一、名目本金餘額</b>                    | <b>27,074,066</b> | <b>21,695,510</b> | <b>34,438</b> | <b>112,115</b> | <b>77,058</b> | <b>-</b> | <b>48,993,187</b> |
| (一)店頭市場(OTC)                       | 27,005,542        | 21,695,510        | 21,416        | 111,804        | 77,058        | -        | 48,911,330        |
| 1. 遠期契約(Forwards)                  | 12,113            | 15,732,208        | 16            | 3,288          | -             | -        | 15,747,625        |
| 2. 交換(Swaps)                       | 25,348,298        | 2,478,844         | 7,309         | 9,938          | 75,558        | -        | 27,919,947        |
| 3. 買入選擇權(Bought Options)           | 780,489           | 1,717,264         | 4,991         | 48,906         | 1,500         | -        | 2,553,150         |
| 4. 賣出選擇權(Sold Options)             | 864,642           | 1,767,194         | 9,100         | 49,672         | -             | -        | 2,690,608         |
| (二)交易所(Exchange-traded Contracts)  | 68,524            | -                 | 13,022        | 311            | -             | -        | 81,857            |
| 1. 期貨-長部位(Futures-Long Positions)  | 1,472             | -                 | 954           | 120            | -             | -        | 2,546             |
| 2. 期貨-短部位(Futures-Short Positions) | 67,052            | -                 | 1,870         | 11             | -             | -        | 68,933            |
| 3. 買入選擇權(Bought Options)           | -                 | -                 | 6,686         | 78             | -             | -        | 6,764             |
| 4. 賣出選擇權(Sold Options)             | -                 | -                 | 3,512         | 102            | -             | -        | 3,614             |
| <b>二、名目本金餘額</b>                    | <b>27,074,066</b> | <b>21,695,510</b> | <b>34,438</b> | <b>112,115</b> | <b>77,058</b> | <b>-</b> | <b>48,993,187</b> |
| (一)交易目的之契約總額                       | 26,789,039        | 21,665,672        | 34,438        | 112,115        | 76,973        | -        | 48,678,237        |
| (二)非交易目的之契約總額                      | 285,027           | 29,838            | -             | -              | 85            | -        | 314,950           |

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)。

幣百萬元；%

|        |
|--------|
| 比重     |
| 100.00 |
| 99.83  |
| 32.14  |
| 56.99  |
| 5.21   |
| 5.49   |
| 0.17   |
| 0.01   |
| 0.14   |
| 0.01   |
| 0.01   |
| 100.00 |
| 99.36  |
| 0.64   |

## 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3月底

單位：新臺幣百萬元；%

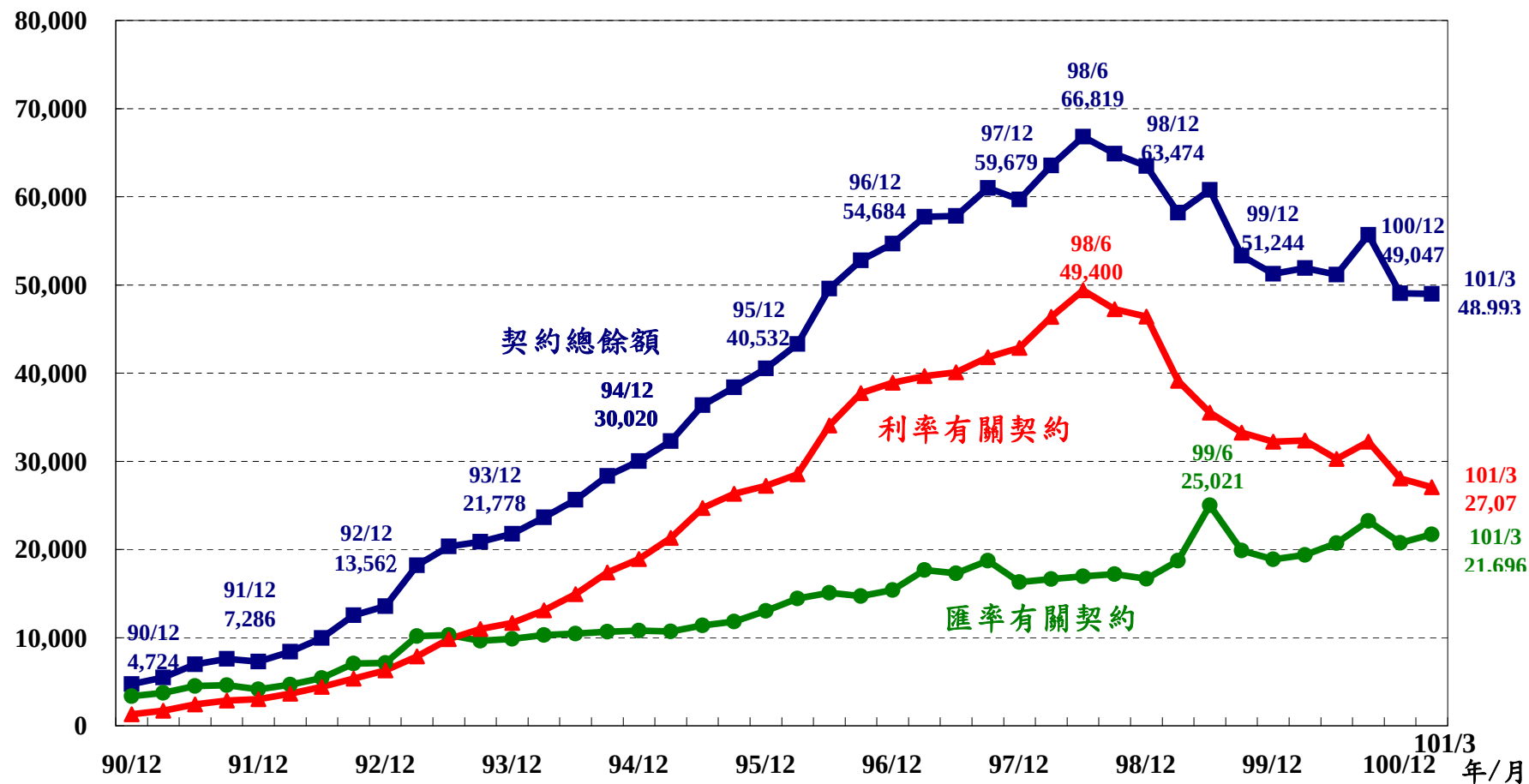
| 項 目                                | 101年3月底           |               | 100年12月底          |               | 比 較 增 減        |              |
|------------------------------------|-------------------|---------------|-------------------|---------------|----------------|--------------|
|                                    | 金額                | 比重            | 金額                | 比重            | 金額             | 變動率          |
| <b>一、名目本金餘額</b>                    | <b>48,993,187</b> | <b>100.00</b> | <b>49,047,225</b> | <b>100.00</b> | <b>-54,038</b> | <b>-0.11</b> |
| (一)店頭市場(OTC)                       | 48,911,330        | 99.83         | 48,984,033        | 99.87         | -72,703        | -0.15        |
| 1.遠期契約(Forwards)                   | 15,747,625        | 32.14         | 15,832,820        | 32.28         | -85,195        | -0.54        |
| 2.交換(Swaps)                        | 27,919,947        | 56.99         | 28,563,383        | 58.24         | -643,436       | -2.25        |
| 3.買入選擇權(Bought Options)            | 2,553,150         | 5.21          | 2,236,029         | 4.56          | 317,121        | 14.18        |
| 4.賣出選擇權(Sold Options)              | 2,690,608         | 5.49          | 2,351,801         | 4.79          | 338,807        | 14.41        |
| (二)交易所(Exchange-traded Contracts)  | 81,857            | 0.17          | 63,192            | 0.13          | 18,665         | 29.54        |
| 1.期貨-長部位(Futures - Long Positions) | 2,546             | 0.01          | 17,521            | 0.04          | -14,975        | -85.47       |
| 2.期貨-短部位(Futures -Short Positions) | 68,933            | 0.14          | 39,477            | 0.08          | 29,456         | 74.62        |
| 3.買入選擇權(Bought Options)            | 6,764             | 0.01          | 4,727             | 0.01          | 2,037          | 43.09        |
| 4.賣出選擇權(Sold Options)              | 3,614             | 0.01          | 1,467             | 0.00          | 2,147          | 146.35       |
| <b>二、名目本金餘額</b>                    | <b>48,993,187</b> | <b>100.00</b> | <b>49,047,225</b> | <b>100.00</b> | <b>-54,038</b> | <b>-0.11</b> |
| (一)交易目的之契約總額                       | 48,678,237        | 99.36         | 48,727,264        | 99.35         | -49,027        | -0.10        |
| (二)非交易目的之契約總額                      | 314,950           | 0.64          | 319,961           | 0.65          | -5,011         | -1.57        |

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

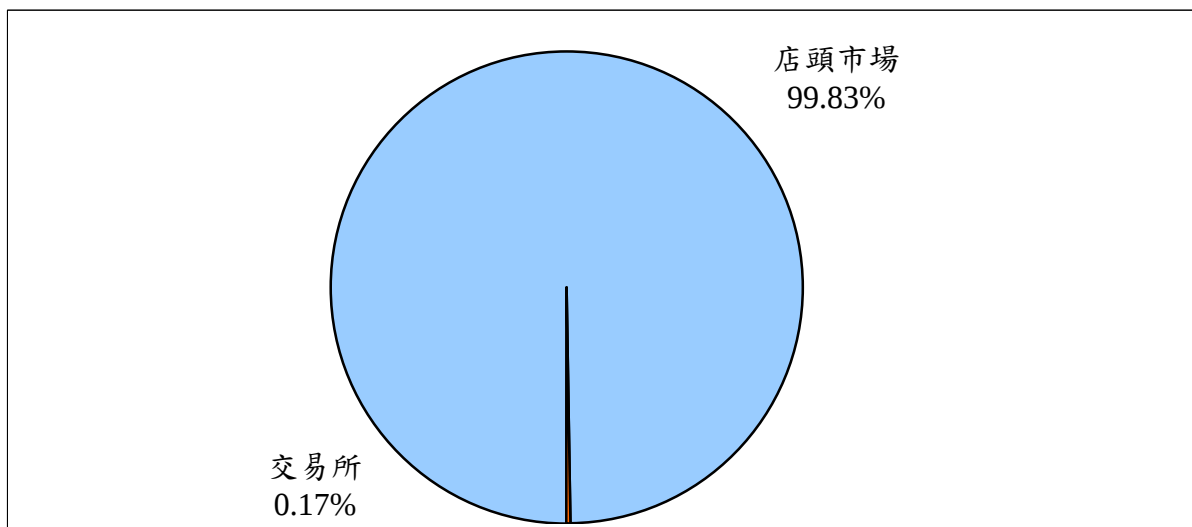
新台幣10億元

101年3月底

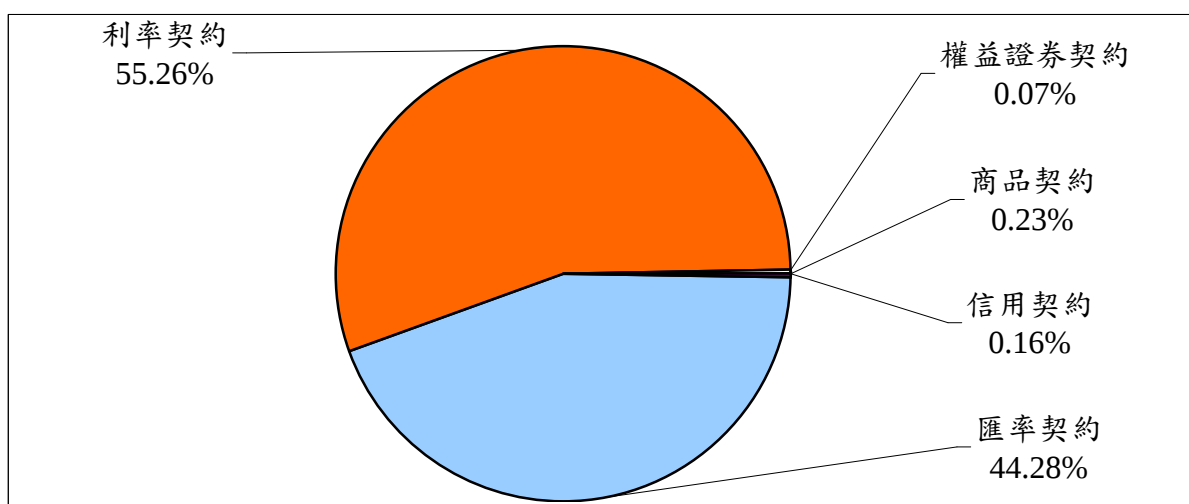


## 附圖2 銀行衍生性金融商品未結清契約內容分析

101年3月底  
市場類別



商品種類別



銀行類別

