

## 附表1 銀行衍生性金融商品未結清契約名目本金餘額

103年9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
<b>一、名目本金餘額</b>	<b>17,782,519</b>	<b>39,025,987</b>	<b>100,717</b>	<b>37,866</b>	<b>45,458</b>	-	<b>56,992,547</b>	<b>100.00</b>
(一)店頭市場(OTC)	17,703,098	39,025,987	68,751	37,037	45,458	-	56,880,331	99.80
1.遠期契約(Forwards)	-	21,804,556	-	251	-	-	21,804,807	38.26
2.交換(Swaps)	17,171,020	2,000,857	40,072	12,552	45,458	-	19,269,959	33.81
3.買入選擇權(Bought Options)	234,069	7,540,078	13,222	11,631	-	-	7,799,000	13.68
4.賣出選擇權(Sold Options)	298,009	7,680,496	15,457	12,603	-	-	8,006,565	14.05
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	79,421	-	31,966	829	-	-	112,216	0.20
1.期貨-長部位(Futures-Long Positions)	18,067	-	2,952	450	-	-	21,469	0.04
2.期貨-短部位(Futures-Short Positions)	42,691	-	675	247	-	-	43,613	0.08
3.買入選擇權(Bought Options)	-	-	12,562	52	-	-	12,614	0.02
4.賣出選擇權(Sold Options)	18,663	-	15,777	80	-	-	34,520	0.06
<b>二、名目本金餘額</b>	<b>17,782,519</b>	<b>39,025,987</b>	<b>100,717</b>	<b>37,866</b>	<b>45,458</b>	-	<b>56,992,547</b>	<b>100.00</b>
(一)交易目的之契約總額	17,571,523	38,947,251	100,717	37,866	45,458	-	56,702,815	99.49
(二)非交易目的之契約總額	210,996	78,736	-	-	-	-	289,732	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(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；%

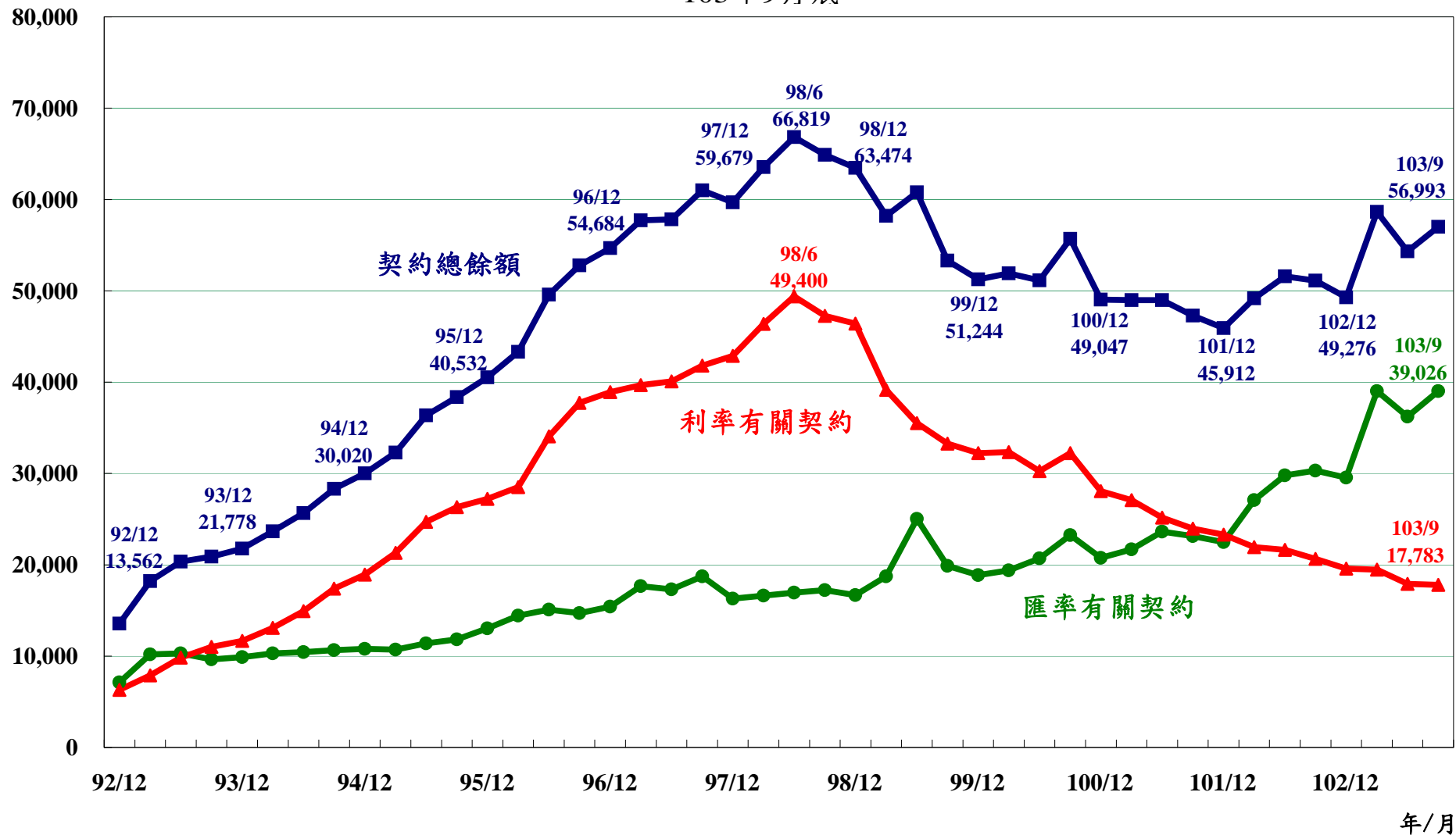
項 目	103年9月底		103年6月底		比 較 增 減	
	金額	比重	金額	比重	金額	變動率
<b>一、名目本金餘額</b>	<b>56,992,547</b>	<b>100.00</b>	<b>54,319,999</b>	<b>100.00</b>	<b>2,672,548</b>	<b>4.92</b>
(一)店頭市場(OTC)	56,880,331	99.80	54,138,736	99.66	2,741,595	5.06
1.遠期契約(Forwards)	21,804,807	38.26	19,619,585	36.12	2,185,222	11.14
2.交換(Swaps)	19,269,959	33.81	19,280,565	35.49	-10,606	-0.06
3.買入選擇權(Bought Options)	7,799,000	13.68	7,506,810	13.82	292,190	3.89
4.賣出選擇權(Sold Options)	8,006,565	14.05	7,731,776	14.23	274,789	3.55
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	112,216	0.20	181,263	0.34	-69,047	-38.09
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	21,469	0.04	57,625	0.11	-36,156	-62.74
2.期貨-短部位(Futures -Short Positions)	43,613	0.08	95,114	0.18	-51,501	-54.15
3.買入選擇權(Bought Options)	12,614	0.02	15,842	0.03	-3,228	-20.38
4.賣出選擇權(Sold Options)	34,520	0.06	12,682	0.02	21,838	172.20
<b>二、名目本金餘額</b>	<b>56,992,547</b>	<b>100.00</b>	<b>54,319,999</b>	<b>100.00</b>	<b>2,672,548</b>	<b>4.92</b>
(一)交易目的之契約總額	56,702,815	99.49	54,022,604	99.45	2,680,211	4.96
(二)非交易目的之契約總額	289,732	0.51	297,395	0.55	-7,663	-2.58

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

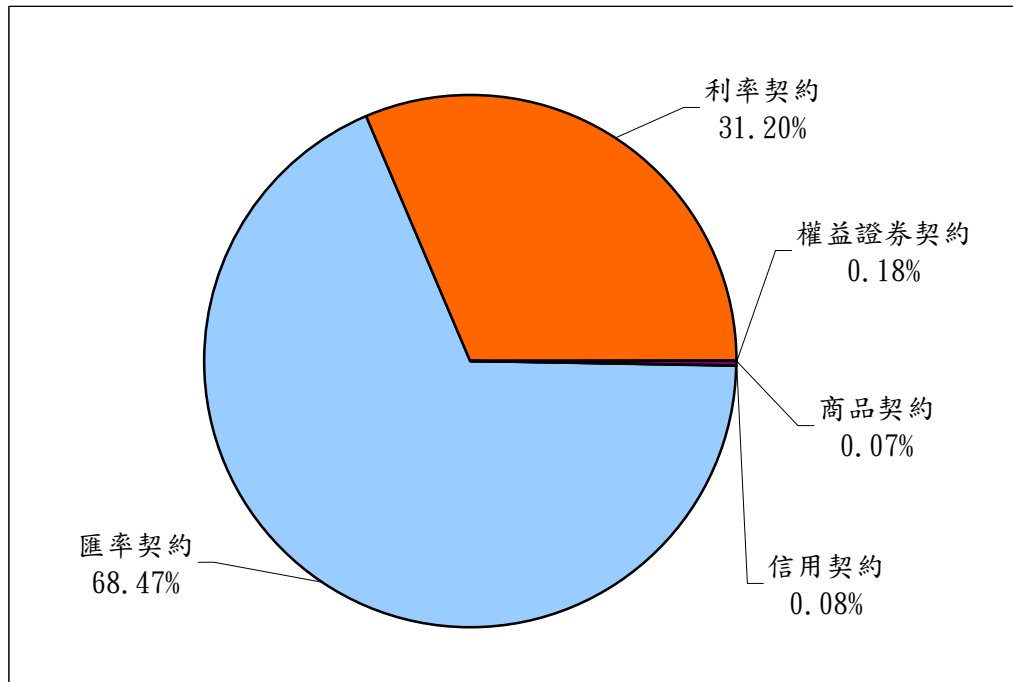
103年9月底



## 附圖2 銀行衍生性金融商品未結清契約內容分析

103年9月底

### 風險類別



### 銀行類別

