

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

103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	19,465,268	39,010,639	98,984	35,481	46,680	-	58,657,052	100.00
(一)店頭市場(OTC)	19,352,840	39,010,639	50,488	33,381	46,680	-	58,494,028	99.72
1.遠期契約(Forwards)	1,095	20,052,039	-	1,430	-	-	20,054,564	34.19
2.交換(Swaps)	18,773,662	1,960,669	31,397	15,040	46,680	-	20,827,448	35.50
3.買入選擇權(Bought Options)	257,726	8,394,388	8,756	8,267	-	-	8,669,137	14.78
4.賣出選擇權(Sold Options)	320,357	8,603,543	10,335	8,644	-	-	8,942,879	15.25
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	112,428	-	48,496	2,100	-	-	163,024	0.28
1.期貨-長部位(Futures-Long Positions)	28,636	-	1,440	1,095	-	-	31,171	0.05
2.期貨-短部位(Futures-Short Positions)	83,792	-	2,758	903	-	-	87,453	0.15
3.買入選擇權(Bought Options)	-	-	21,593	66	-	-	21,659	0.04
4.賣出選擇權(Sold Options)	-	-	22,705	36	-	-	22,741	0.04
二、名目本金餘額	19,465,268	39,010,639	98,984	35,481	46,680	-	58,657,052	100.00
(一)交易目的之契約總額	19,228,150	38,983,968	98,819	35,481	46,593	-	58,393,011	99.55
(二)非交易目的之契約總額	237,118	26,671	165	-	87	-	264,041	0.45

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

103年3月底

單位：新臺幣百萬元；%

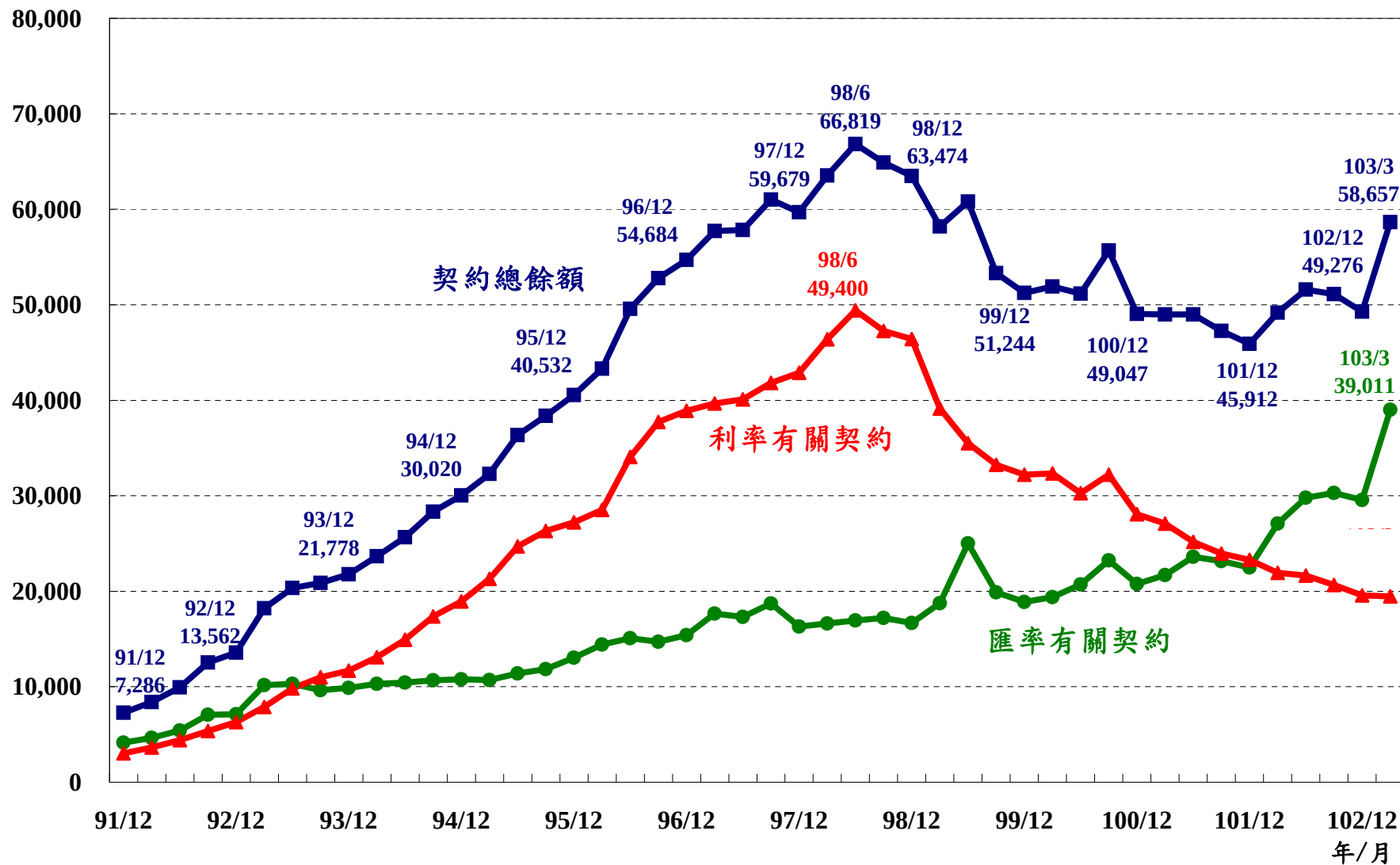
項 目	103年3月底		102年12月底		比 較 增 減	
	金額	比重	金額	比重	金額	變動率
一、名目本金餘額	58,657,052	100.00	49,276,370	100.00	9,380,682	19.04
(一)店頭市場(OTC)	58,494,028	99.72	49,169,298	99.78	9,324,730	18.96
1.遠期契約(Forwards)	20,054,564	34.19	18,763,995	38.08	1,290,569	6.88
2.交換(Swaps)	20,827,448	35.50	21,197,666	43.02	-370,218	-1.75
3.買入選擇權(Bought Options)	8,669,137	14.78	4,531,929	9.19	4,137,208	91.29
4.賣出選擇權(Sold Options)	8,942,879	15.25	4,675,708	9.49	4,267,171	91.26
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	163,024	0.28	107,072	0.22	55,952	52.26
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	31,171	0.05	23,423	0.05	7,748	33.08
2.期貨-短部位(Futures -Short Positions)	87,453	0.15	55,623	0.11	31,830	57.22
3.買入選擇權(Bought Options)	21,659	0.04	13,505	0.03	8,154	60.38
4.賣出選擇權(Sold Options)	22,741	0.04	14,521	0.03	8,220	56.61
二、名目本金餘額	58,657,052	100.00	49,276,370	100.00	9,380,682	19.04
(一)交易目的之契約總額	58,393,011	99.55	48,982,277	99.40	9,410,734	19.21
(二)非交易目的之契約總額	264,041	0.45	294,093	0.60	-30,052	-10.22

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

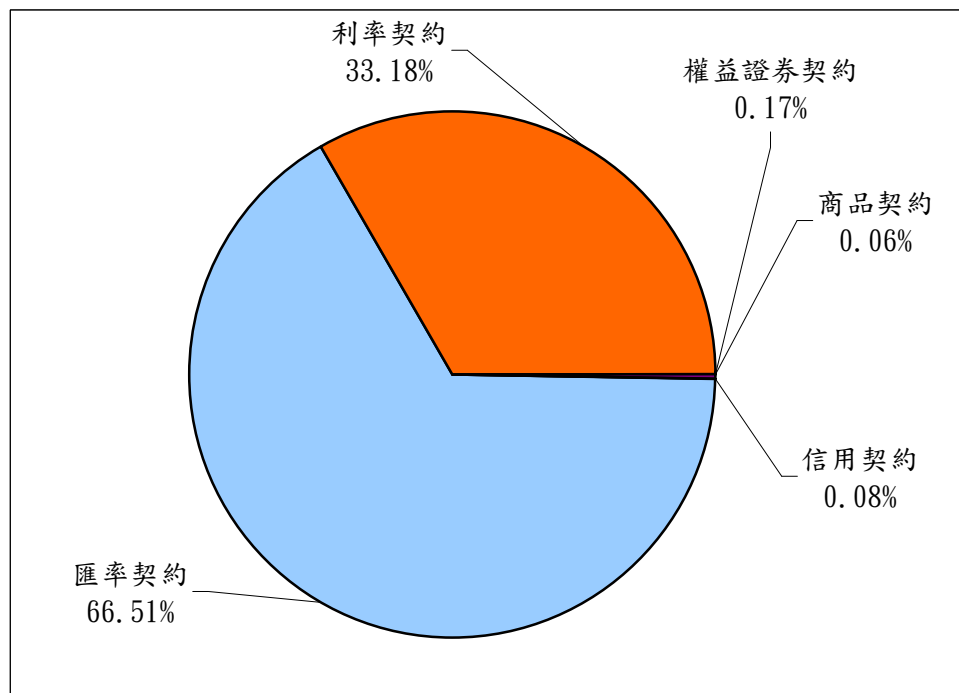
103年3月底



附圖2 銀行衍生性金融商品未結清契約內容分析

103年3月底

風險類別



銀行類別

