

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
一、名目本金餘額	20,650,189	30,306,394	68,199	41,708	54,967	-	51,121,457	100.00
(一)店頭市場(OTC)	20,592,039	30,306,394	47,033	40,664	54,967	-	51,041,097	99.84
1.遠期契約(Forwards)	7,013	17,867,273	-	1,142	-	-	17,875,428	34.97
2.交換(Swaps)	19,889,224	2,720,770	30,688	13,979	54,967	-	22,709,628	44.42
3.買入選擇權(Bought Options)	314,512	4,868,141	7,046	12,655	-	-	5,202,354	10.17
4.賣出選擇權(Sold Options)	381,290	4,850,210	9,299	12,888	-	-	5,253,687	10.28
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	58,150	-	21,166	1,044	-	-	80,360	0.16
1.期貨-長部位(Futures-Long Positions)	11,782	-	757	332	-	-	12,871	0.02
2.期貨-短部位(Futures-Short Positions)	46,368	-	2,540	336	-	-	49,244	0.10
3.買入選擇權(Bought Options)	-	-	9,107	20	-	-	9,127	0.02
4.賣出選擇權(Sold Options)	-	-	8,762	356	-	-	9,118	0.02
二、名目本金餘額	20,650,189	30,306,394	68,199	41,708	54,967	-	51,121,457	100.00
(一)交易目的之契約總額	20,383,977	30,275,960	67,994	41,708	54,882	-	50,824,521	99.42
(二)非交易目的之契約總額	266,212	30,434	205	-	85	-	296,936	0.58

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(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9月底

單位：新臺幣百萬元，%

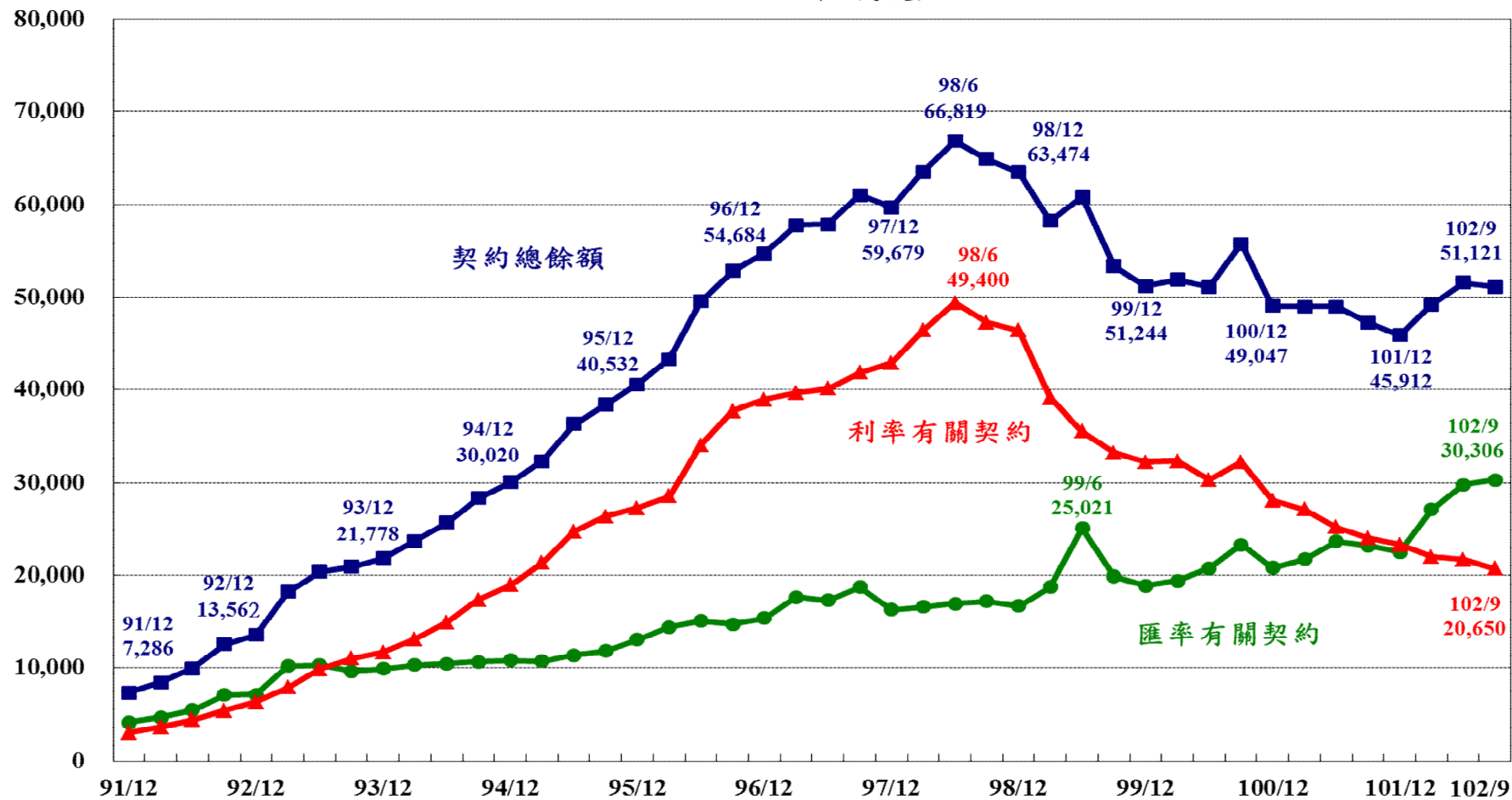
項 目	102年9月底		102年6月底		比 較 增 減	
	金額	比重	金額	比重	金額	變動率
一、名目本金餘額	51,121,457	100.00	51,583,103	100.00	-461,646	-0.89
(一)店頭市場(OTC)	51,041,097	99.84	51,522,702	99.88	-481,605	-0.93
1.遠期契約(Forwards)	17,875,428	34.97	17,798,954	34.51	76,474	0.43
2.交換(Swaps)	22,709,628	44.42	23,957,639	46.44	-1,248,011	-5.21
3.買入選擇權(Bought Options)	5,202,354	10.17	4,798,276	9.30	404,078	8.42
4.賣出選擇權(Sold Options)	5,253,687	10.28	4,967,833	9.63	285,854	5.75
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	80,360	0.16	60,401	0.12	19,959	33.04
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	12,871	0.02	9,144	0.02	3,727	40.76
2.期貨-短部位(Futures -Short Positions)	49,244	0.10	32,357	0.06	16,887	52.19
3.買入選擇權(Bought Options)	9,127	0.02	8,466	0.02	661	7.81
4.賣出選擇權(Sold Options)	9,118	0.02	10,434	0.02	-1,316	-12.61
二、名目本金餘額	51,121,457	100.00	51,583,103	100.00	-461,646	-0.89
(一)交易目的之契約總額	50,824,521	99.42	51,272,704	99.40	-448,183	-0.87
(二)非交易目的之契約總額	296,936	0.58	310,399	0.60	-13,463	-4.34

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9月底

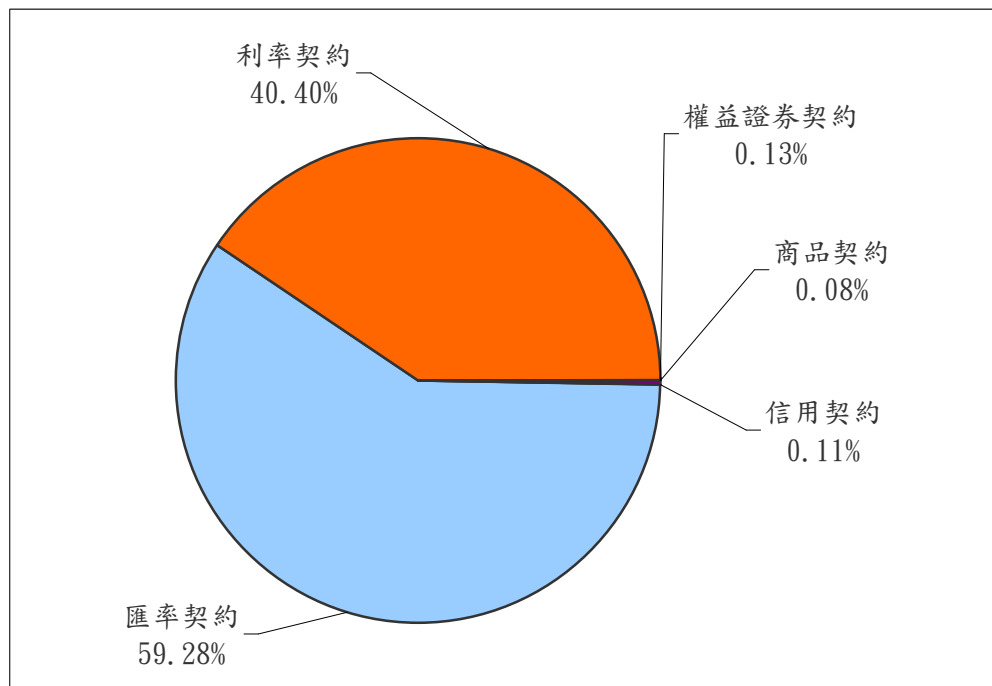


年/月

附圖2 銀行衍生性金融商品未結清契約內容分析

102年9月底

風險類別



銀行類別

