

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6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	17,911,930	36,215,505	118,961	30,102	43,501	-	54,319,999	100.00
(一)店頭市場(OTC)	17,762,925	36,215,505	87,399	29,406	43,501	-	54,138,736	99.66
1.遠期契約(Forwards)	-	19,618,996	-	589	-	-	19,619,585	36.12
2.交換(Swaps)	17,236,596	1,931,275	59,591	9,602	43,501	-	19,280,565	35.49
3.買入選擇權(Bought Options)	237,126	7,247,204	13,180	9,300	-	-	7,506,810	13.82
4.賣出選擇權(Sold Options)	289,203	7,418,030	14,628	9,915	-	-	7,731,776	14.23
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	149,005	-	31,562	696	-	-	181,263	0.34
1.期貨-長部位(Futures-Long Positions)	55,530	-	1,629	466	-	-	57,625	0.11
2.期貨-短部位(Futures-Short Positions)	93,475	-	1,477	162	-	-	95,114	0.18
3.買入選擇權(Bought Options)	-	-	15,783	59	-	-	15,842	0.03
4.賣出選擇權(Sold Options)	-	-	12,673	9	-	-	12,682	0.02
二、名目本金餘額	17,911,930	36,215,505	118,961	30,102	43,501	-	54,319,999	100.00
(一)交易目的之契約總額	17,687,631	36,142,509	118,861	30,102	43,501	-	54,022,604	99.45
(二)非交易目的之契約總額	224,299	72,996	100	-	-	-	297,395	0.55

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；%

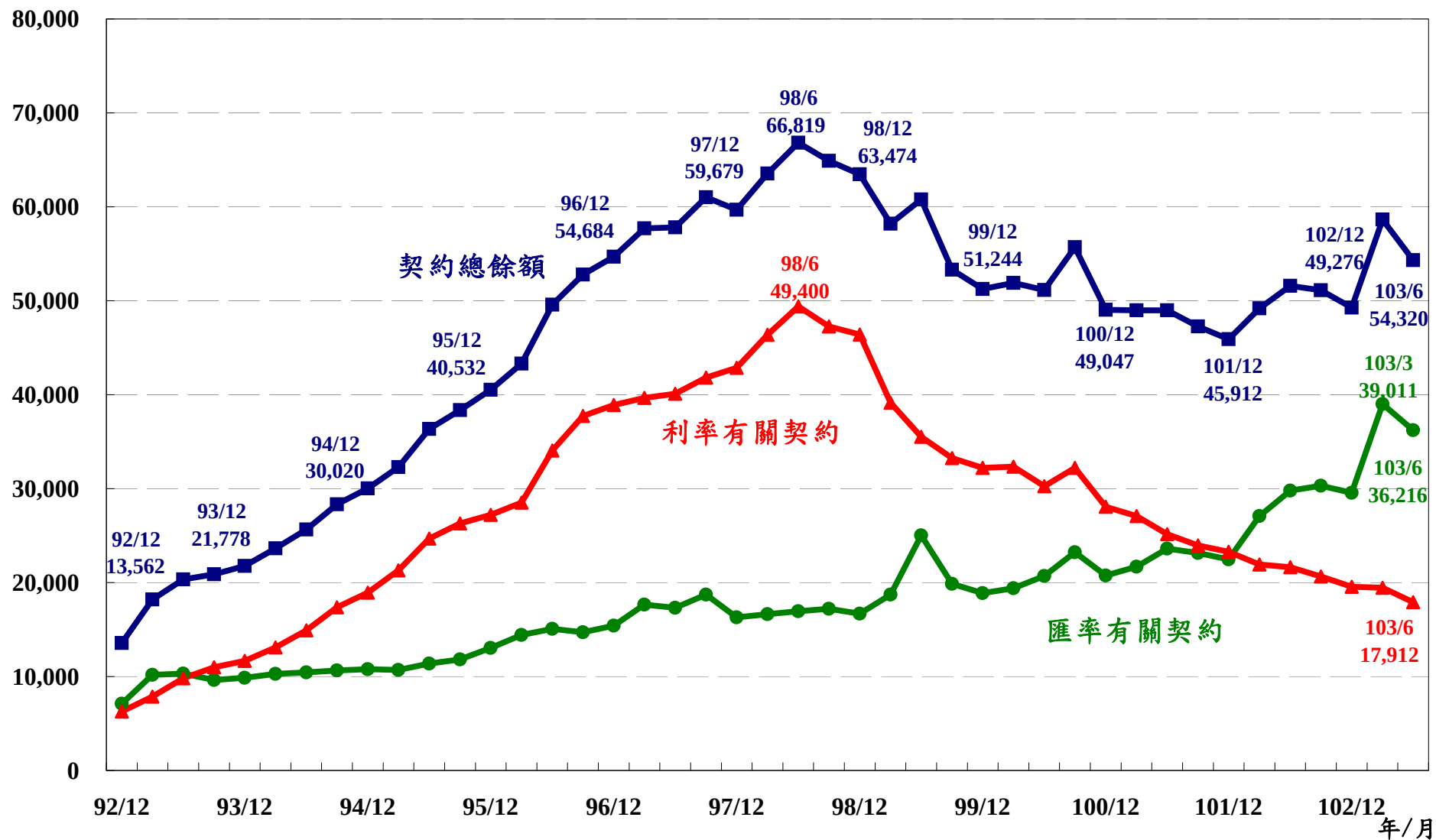
項 目	103年6月底		103年3月底		比 較 增 減	
	金額	比重	金額	比重	金額	變動率
一、名目本金餘額	54,319,999	100.00	58,657,052	100.00	-4,337,053	-7.39
(一)店頭市場(OTC)	54,138,736	99.66	58,494,028	99.72	-4,355,292	-7.45
1.遠期契約(Forwards)	19,619,585	36.12	20,054,564	34.19	-434,979	-2.17
2.交換(Swaps)	19,280,565	35.49	20,827,448	35.50	-1,546,883	-7.43
3.買入選擇權(Bought Options)	7,506,810	13.82	8,669,137	14.78	-1,162,327	-13.41
4.賣出選擇權(Sold Options)	7,731,776	14.23	8,942,879	15.25	-1,211,103	-13.54
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	181,263	0.34	163,024	0.28	18,239	11.19
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	57,625	0.11	31,171	0.05	26,454	84.87
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	95,114	0.18	87,453	0.15	7,661	8.76
3.買入選擇權(Bought Options)	15,842	0.03	21,659	0.04	-5,817	-26.86
4.賣出選擇權(Sold Options)	12,682	0.02	22,741	0.04	-10,059	-44.23
二、名目本金餘額	54,319,999	100.00	58,657,052	100.00	-4,337,053	-7.39
(一)交易目的之契約總額	54,022,604	99.45	58,393,011	99.55	-4,370,407	-7.48
(二)非交易目的之契約總額	297,395	0.55	264,041	0.45	33,354	12.63

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

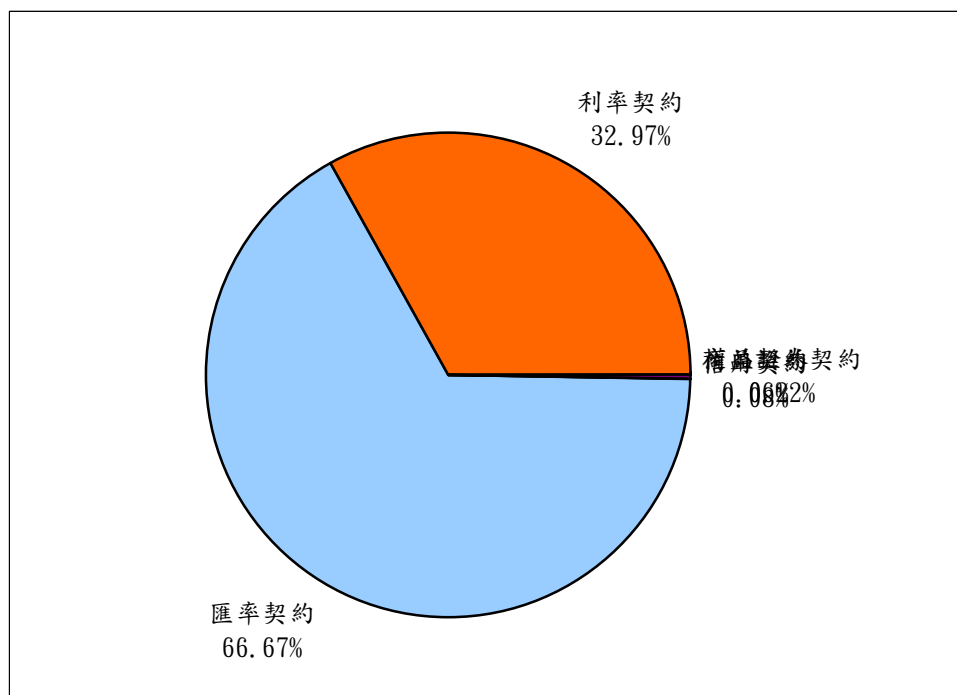
103年6月底



附圖2 銀行衍生性金融商品未結清契約內容分析

103年6月底

風險類別



銀行類別

