

附表1 銀行衍生性金融商品餘額季報表

101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	23,957,629	23,147,474	36,753	49,463	82,388	-	47,273,707	100.00
(一)店頭市場(OTC)	23,920,167	23,147,474	25,065	49,037	82,388	-	47,224,131	99.89
1.遠期契約(Forwards)	9,644	16,020,503	-	964	-	-	16,031,111	33.91
2.交換(Swaps)	22,725,637	2,376,138	9,132	13,594	80,888	-	25,205,389	53.32
3.買入選擇權(Bought Options)	558,613	2,364,387	5,943	16,670	1,500	-	2,947,113	6.23
4.賣出選擇權(Sold Options)	626,273	2,386,446	9,990	17,809	-	-	3,040,518	6.43
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	37,462	-	11,688	426	-	-	49,576	0.11
1.期貨-長部位(Futures-Long Positions)	2,448	-	212	21	-	-	2,681	0.01
2.期貨-短部位(Futures-Short Positions)	35,014	-	484	54	-	-	35,552	0.08
3.買入選擇權(Bought Options)	-	-	6,126	95	-	-	6,221	0.01
4.賣出選擇權(Sold Options)	-	-	4,866	256	-	-	5,122	0.01
二、名目本金餘額	23,957,629	23,147,474	36,753	49,463	82,388	-	47,273,707	100.00
(一)交易目的之契約總額	23,682,186	23,121,174	36,753	49,463	82,304	-	46,971,880	99.36
(二)非交易目的之契約總額	275,443	26,300	-	-	84	-	301,827	0.64

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名目本金餘額季報比較表

101年9月底

單位：新臺幣百萬元；%

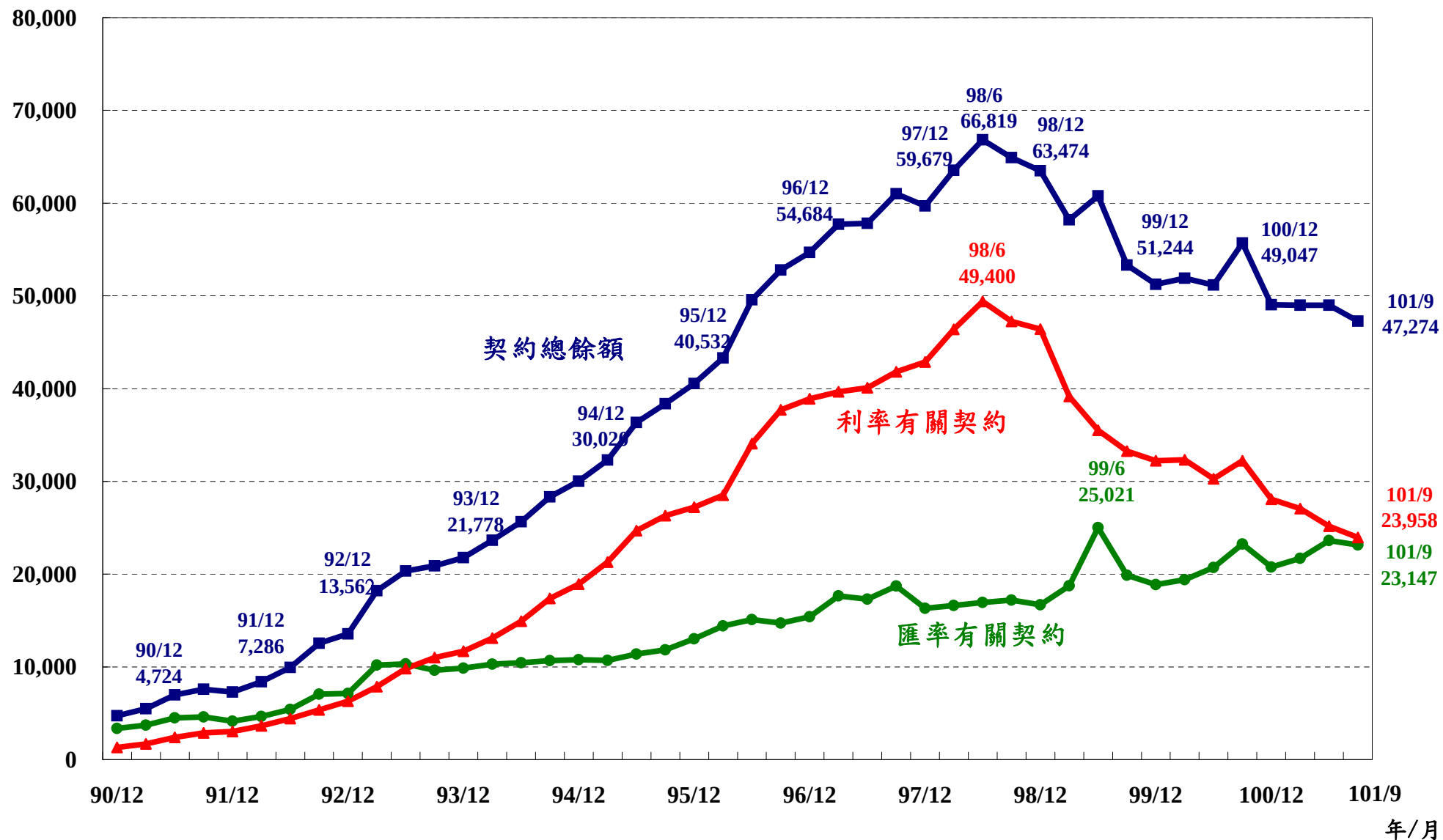
項 目	101年9月底		101年6月底		比 較 增 減	
	金額	比重	金額	比重	金額	變動率
一、名目本金餘額	47,273,707	100.00	48,982,465	100.00	-1,708,758	-3.49
(一)店頭市場(OTC)	47,224,131	99.89	48,899,920	99.83	-1,675,789	-3.43
1.遠期契約(Forwards)	16,031,111	33.91	16,815,729	34.33	-784,618	-4.67
2.交換(Swaps)	25,205,389	53.32	26,189,955	53.47	-984,566	-3.76
3.買入選擇權(Bought Options)	2,947,113	6.23	2,884,041	5.89	63,072	2.19
4.賣出選擇權(Sold Options)	3,040,518	6.43	3,010,195	6.14	30,323	1.01
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	49,576	0.11	82,545	0.17	-32,969	-39.94
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	2,681	0.01	6,928	0.01	-4,247	-61.30
2.期貨-短部位(Futures -Short Positions)	35,552	0.08	68,907	0.14	-33,355	-48.41
3.買入選擇權(Bought Options)	6,221	0.01	3,507	0.01	2,714	77.39
4.賣出選擇權(Sold Options)	5,122	0.01	3,203	0.01	1,919	59.91
二、名目本金餘額	47,273,707	100.00	48,982,465	100.00	-1,708,758	-3.49
(一)交易目的之契約總額	46,971,880	99.36	48,662,775	99.35	-1,690,895	-3.47
(二)非交易目的之契約總額	301,827	0.64	319,690	0.65	-17,863	-5.59

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

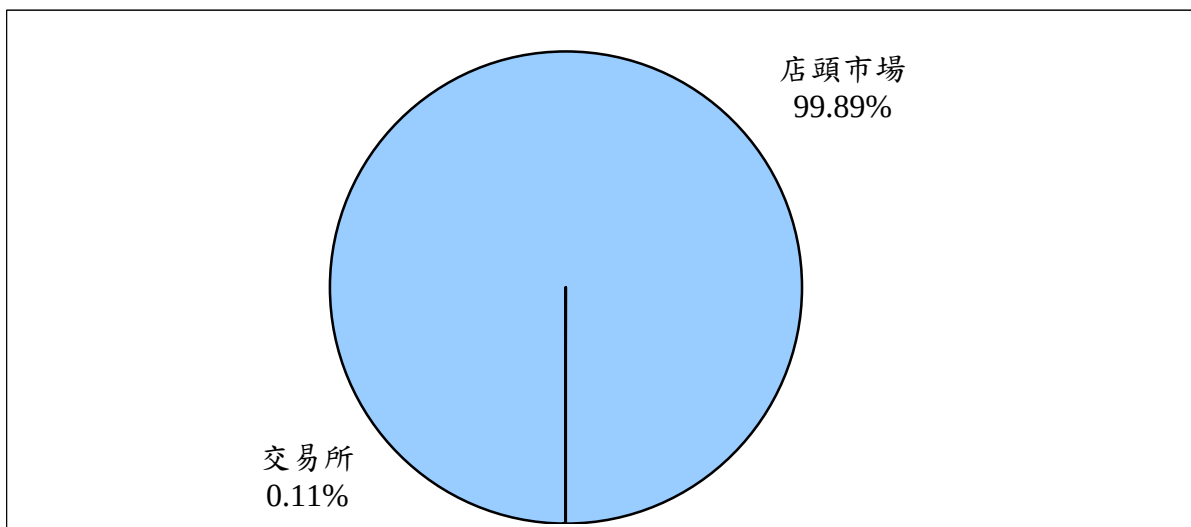
新臺幣10億元

101年9月底

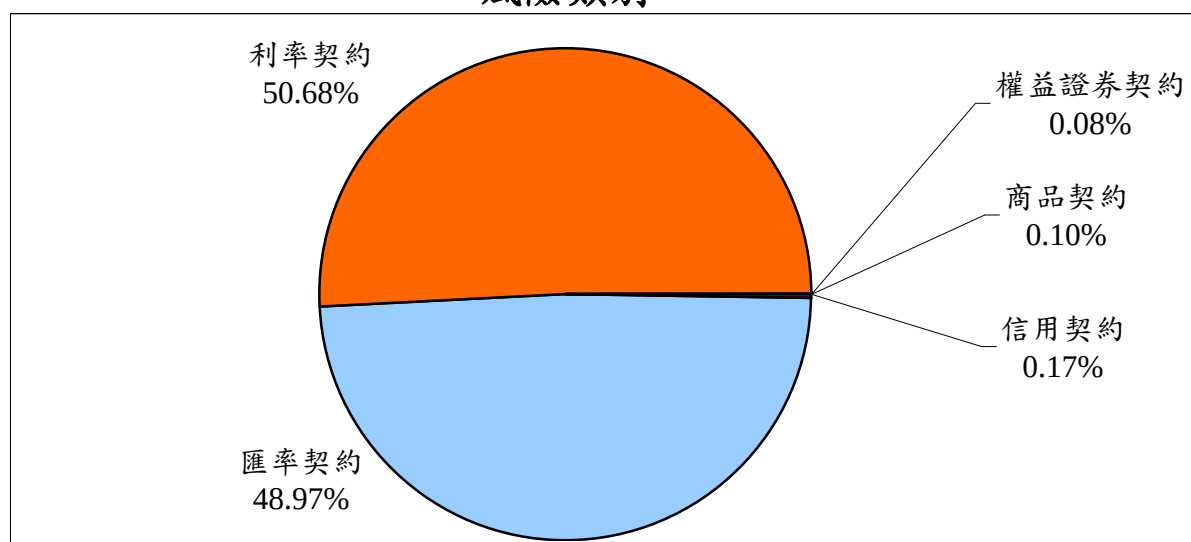


附圖2 銀行衍生性金融商品未結清契約內容分析

101年9月底
市場類別



風險類別



銀行類別

