

附表1 銀行衍生性金融商品未結清契約名目本金餘額

106年9月底
市場別

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、店頭市場(OTC) | 14,899,305 | 33,875,463 | 14,857 | 14,719 | 45,029 | - | 48,849,373 | 99.49 |
| (一)遠期契約(Forwards) | - | 30,280,928 | - | 346 | - | - | 30,281,274 | 61.67 |
| (二)交換(Swaps) | 14,280,012 | 1,683,262 | 11,551 | 10,120 | 45,029 | - | 16,029,974 | 32.65 |
| (三)買入選擇權(Bought Options) | 126,244 | 960,014 | 1,497 | 1,436 | - | - | 1,089,191 | 2.22 |
| (四)賣出選擇權(Sold Options) | 493,049 | 951,259 | 1,809 | 2,817 | - | - | 1,448,934 | 2.95 |
| 二、交易所(Exchange-traded Contracts) | 212,636 | 31,424 | 9,334 | 358 | - | - | 253,752 | 0.51 |
| (一)期貨-長部位(Futures-Long Positions) | 67,447 | 9,429 | 647 | 86 | - | - | 77,609 | 0.16 |
| (二)期貨-短部位(Futures-Short Positions) | 144,462 | 7,019 | 744 | 222 | - | - | 152,447 | 0.30 |
| (三)買入選擇權(Bought Options) | 727 | 8,091 | 4,352 | 3 | - | - | 13,173 | 0.03 |
| (四)賣出選擇權(Sold Options) | - | 6,885 | 3,591 | 47 | - | - | 10,523 | 0.02 |
| 合 計 | 15,111,941 | 33,906,887 | 24,191 | 15,077 | 45,029 | - | 49,103,125 | 100.00 |

目 的 別

| 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、交易目的 | 14,940,390 | 33,866,650 | 23,961 | 15,077 | 45,029 | - | 48,891,107 | 99.57 |
| 二、非交易目的 | 171,551 | 40,237 | 230 | - | - | - | 212,018 | 0.43 |
| 合 計 | 15,111,941 | 33,906,887 | 24,191 | 15,077 | 45,029 | - | 49,103,125 | 100.00 |

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)及外國與大陸地區銀行(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；%

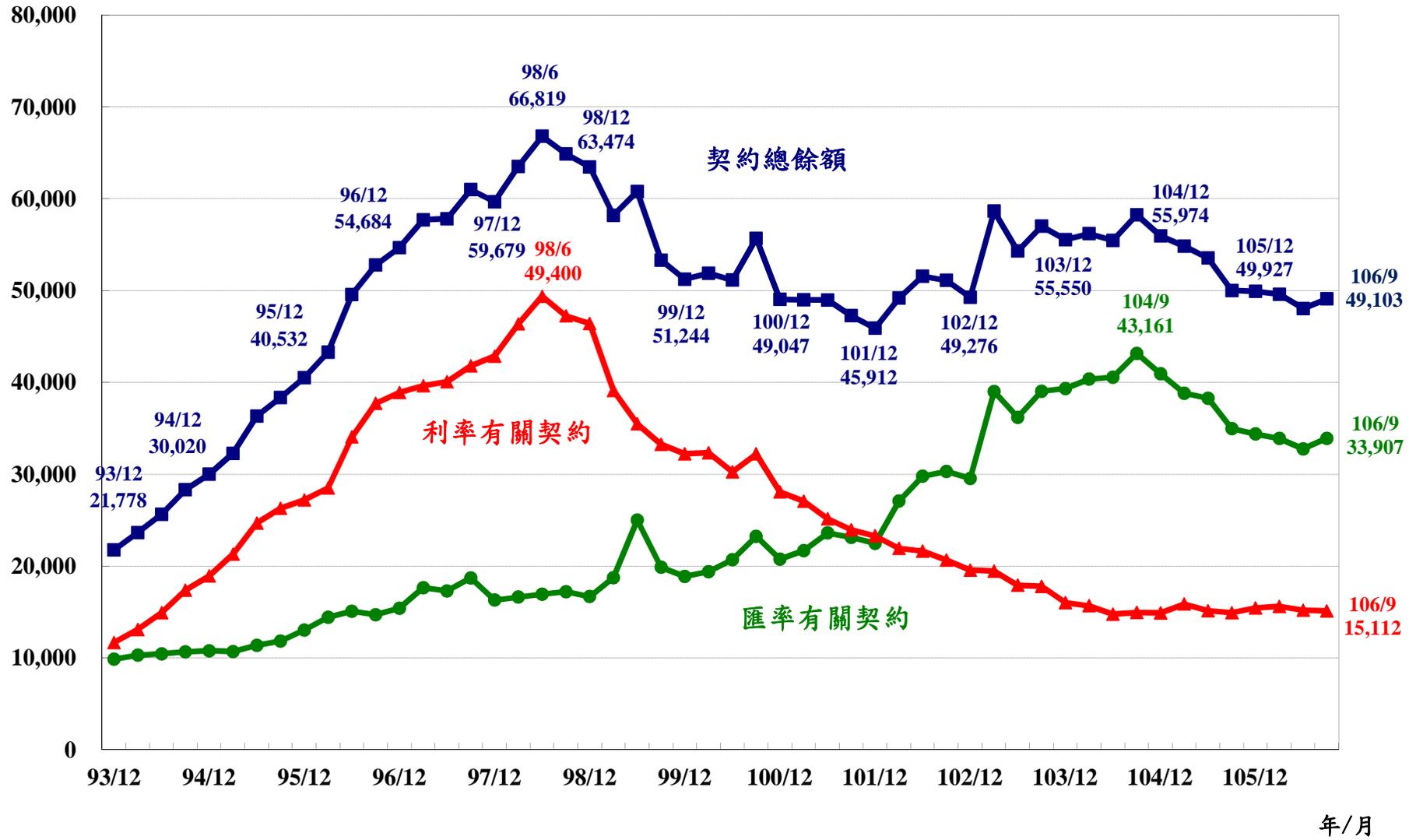
| 項 目 | 106年9月底 | | 106年6月底 | | 比較增減 | |
|---|-------------------|---------------|-------------------|---------------|------------------|-------------|
| | 金額 | 比重 | 金額 | 比重 | 金額 | 變動率 |
| 一、店頭市場(OTC) | 48,849,373 | 99.49 | 47,836,643 | 99.52 | 1,012,730 | 2.12 |
| (一)遠期契約(Forwards) | 30,281,274 | 61.67 | 28,661,100 | 59.63 | 1,620,174 | 5.65 |
| (二)交換(Swaps) | 16,029,974 | 32.65 | 16,371,757 | 34.06 | -341,783 | -2.09 |
| (三)買入選擇權(Bought Options) | 1,089,191 | 2.22 | 1,246,676 | 2.59 | -157,485 | -12.63 |
| (四)賣出選擇權(Sold Options) | 1,448,934 | 2.95 | 1,557,110 | 3.24 | -108,176 | -6.95 |
| 二、交易所(Exchange-traded Contracts) | 253,752 | 0.51 | 225,941 | 0.48 | 27,811 | 12.31 |
| (一)期貨-長部位(Futures-Long Positions) | 77,609 | 0.16 | 83,089 | 0.17 | -5,480 | -6.60 |
| (二)期貨-短部位(Futures-Short Positions) | 152,447 | 0.30 | 123,208 | 0.27 | 29,239 | 23.73 |
| (三)買入選擇權(Bought Options) | 13,173 | 0.03 | 8,653 | 0.02 | 4,520 | 52.24 |
| (四)賣出選擇權(Sold Options) | 10,523 | 0.02 | 10,991 | 0.02 | -468 | -4.26 |
| 合 計 | 49,103,125 | 100.00 | 48,062,584 | 100.00 | 1,040,541 | 2.16 |

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)及外國與大陸地區銀行(一般分行及國際金融業務分行)。

附圖1 銀行衍生性金融商品未結清契約統計

新臺幣10億元

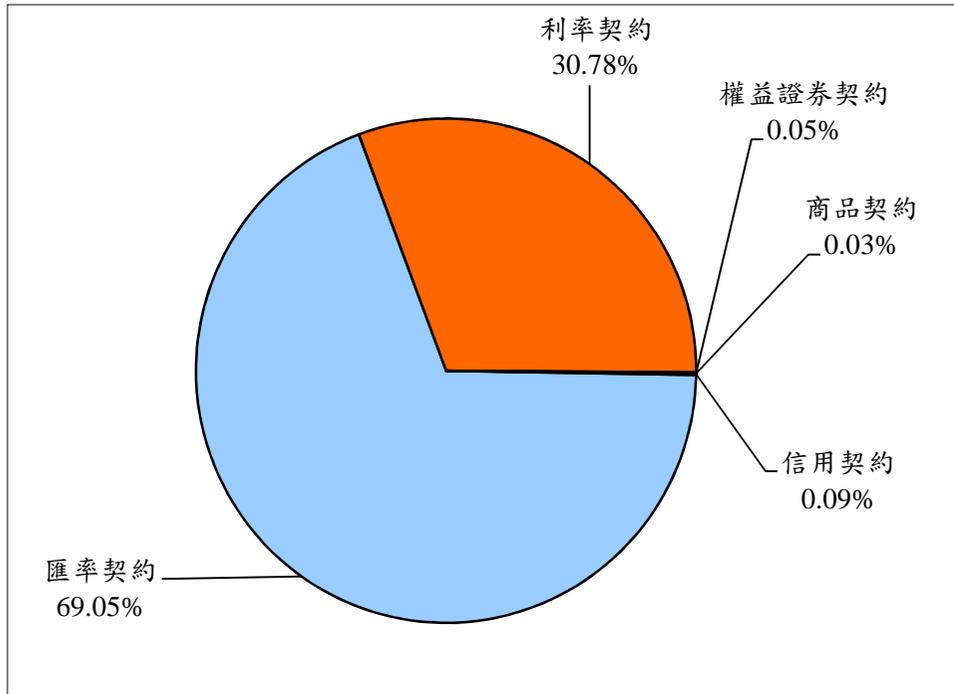
106年9月底



附圖2 銀行衍生性金融商品未結清契約內容分析

106年9月底

風險類別



銀行類別

