

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	21,629,884	29,782,392	60,017	53,881	56,929	-	51,583,103	100.00
(一)店頭市場(OTC)	21,593,025	29,782,392	38,020	52,336	56,929	-	51,522,702	99.88
1.遠期契約(Forwards)	2,981	17,793,348	-	2,625	-	-	17,798,954	34.51
2.交換(Swaps)	20,865,615	3,002,988	18,266	14,141	56,629	-	23,957,639	46.44
3.買入選擇權(Bought Options)	332,053	4,439,454	8,220	18,249	300	-	4,798,276	9.30
4.賣出選擇權(Sold Options)	392,376	4,546,602	11,534	17,321	-	-	4,967,833	9.63
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	36,859	-	21,997	1,545	-	-	60,401	0.12
1.期貨-長部位(Futures-Long Positions)	6,281	-	1,690	1,173	-	-	9,144	0.02
2.期貨-短部位(Futures-Short Positions)	30,578	-	1,523	256	-	-	32,357	0.06
3.買入選擇權(Bought Options)	-	-	8,424	42	-	-	8,466	0.02
4.賣出選擇權(Sold Options)	-	-	10,360	74	-	-	10,434	0.02
二、名目本金餘額	21,629,884	29,782,392	60,017	53,881	56,929	-	51,583,103	100.00
(一)交易目的之契約總額	21,359,107	29,743,251	59,622	53,881	56,843	-	51,272,704	99.40
(二)非交易目的之契約總額	270,777	39,141	395	-	86	-	310,399	0.60

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6月底

單位：新臺幣百萬元；%

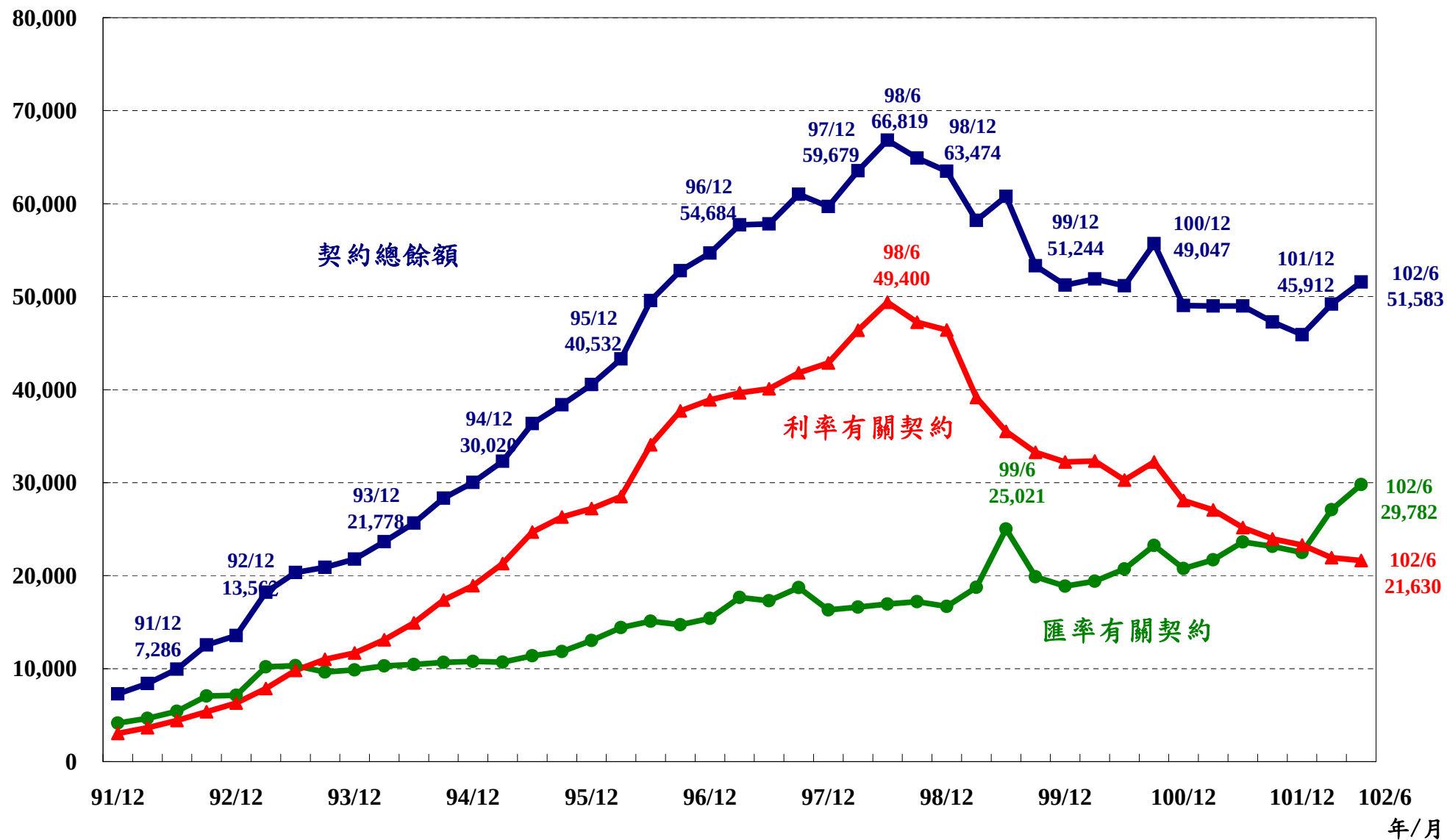
項 目	102年6月底		102年3月底		比 較 增 減	
	金額	比重	金額	比重	金額	變動率
一、名目本金餘額	51,583,103	100.00	49,184,257	100.00	2,398,846	4.88
(一)店頭市場(OTC)	51,522,702	99.88	49,083,615	99.80	2,439,087	4.97
1.遠期契約(Forwards)	17,798,954	34.51	17,299,944	35.17	499,010	2.88
2.交換(Swaps)	23,957,639	46.44	23,600,015	47.99	357,624	1.52
3.買入選擇權(Bought Options)	4,798,276	9.30	3,995,281	8.12	802,995	20.10
4.賣出選擇權(Sold Options)	4,967,833	9.63	4,188,375	8.52	779,458	18.61
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	60,401	0.12	100,642	0.20	-40,241	-39.98
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	9,144	0.02	12,655	0.02	-3,511	-27.74
2.期貨-短部位(Futures -Short Positions)	32,357	0.06	68,355	0.14	-35,998	-52.66
3.買入選擇權(Bought Options)	8,466	0.02	11,017	0.02	-2,551	-23.16
4.賣出選擇權(Sold Options)	10,434	0.02	8,615	0.02	1,819	21.11
二、名目本金餘額	51,583,103	100.00	49,184,257	100.00	2,398,846	4.88
(一)交易目的之契約總額	51,272,704	99.40	48,872,876	99.37	2,399,828	4.91
(二)非交易目的之契約總額	310,399	0.60	311,381	0.63	-982	-0.32

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

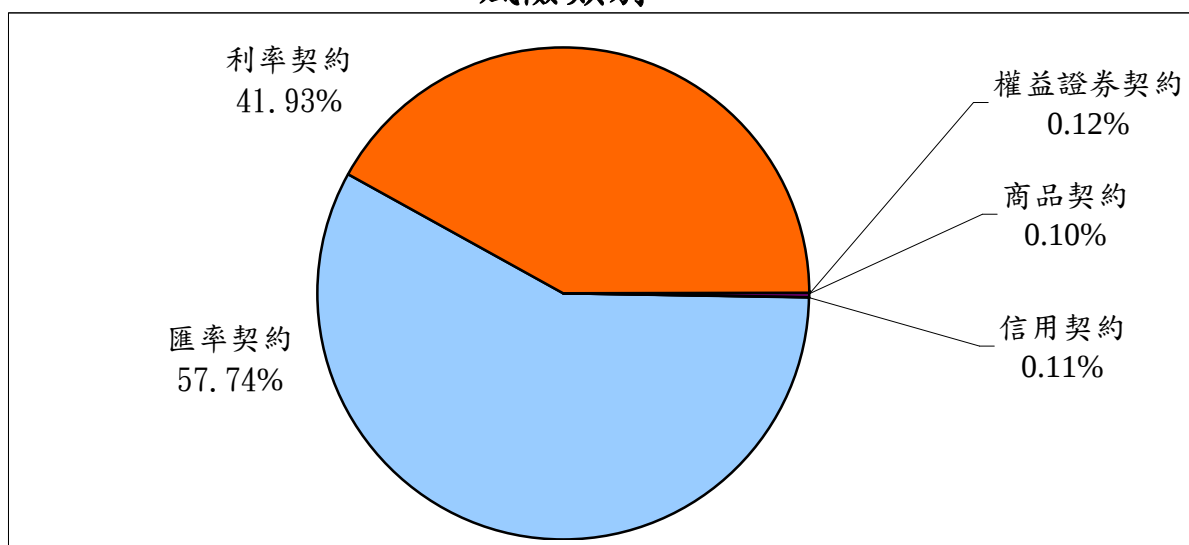
102年6月底



附圖2 銀行衍生性金融商品未結清契約內容分析

102年6月底

風險類別



銀行類別

