

## 銀行衍生性金融商品餘額季報表

100年12月底

單位：新臺幣

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
<b>一、名日本金餘額</b>	<b>28,066,210</b>	<b>20,761,248</b>	<b>28,077</b>	<b>103,859</b>	<b>87,831</b>	-	<b>49,047,225</b>
(一)店頭市場(OTC)	28,010,133	20,761,248	21,018	103,803	87,831	-	48,984,033
1.遠期契約(Forwards)	2,235	15,829,896	-	689	-	-	15,832,820
2.交換(Swaps)	26,011,609	2,447,880	6,148	11,415	86,331	-	28,563,383
3.買入選擇權(Bought Options)	967,267	1,216,481	4,918	45,863	1,500	-	2,236,029
4.賣出選擇權(Sold Options)	1,029,022	1,266,991	9,952	45,836	-	-	2,351,801
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	56,077	-	7,059	56	-	-	63,192
1.期貨-長部位(Futures-Long Positions)	17,018	-	499	4	-	-	17,521
2.期貨-短部位(Futures-Short Positions)	39,059	-	418	-	-	-	39,477
3.買入選擇權(Bought Options)	-	-	4,712	15	-	-	4,727
4.賣出選擇權(Sold Options)	-	-	1,430	37	-	-	1,467
<b>二、名日本金餘額</b>	<b>28,066,210</b>	<b>20,761,248</b>	<b>28,077</b>	<b>103,859</b>	<b>87,831</b>	-	<b>49,047,225</b>
(一)交易目的之契約總額	27,783,498	20,724,389	28,077	103,859	87,441	-	48,727,264
(二)非交易目的之契約總額	282,712	36,859	-	-	390	-	319,961

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)。

百萬元

百分比
<b>100.00%</b>
99.87%
32.28%
58.24%
4.56%
4.79%
0.13%
0.04%
0.08%
0.01%
0.00%
<b>100.00%</b>
99.35%
0.65%

## 銀行衍生性金融商品名目本金餘額季報比較表

100年12月底

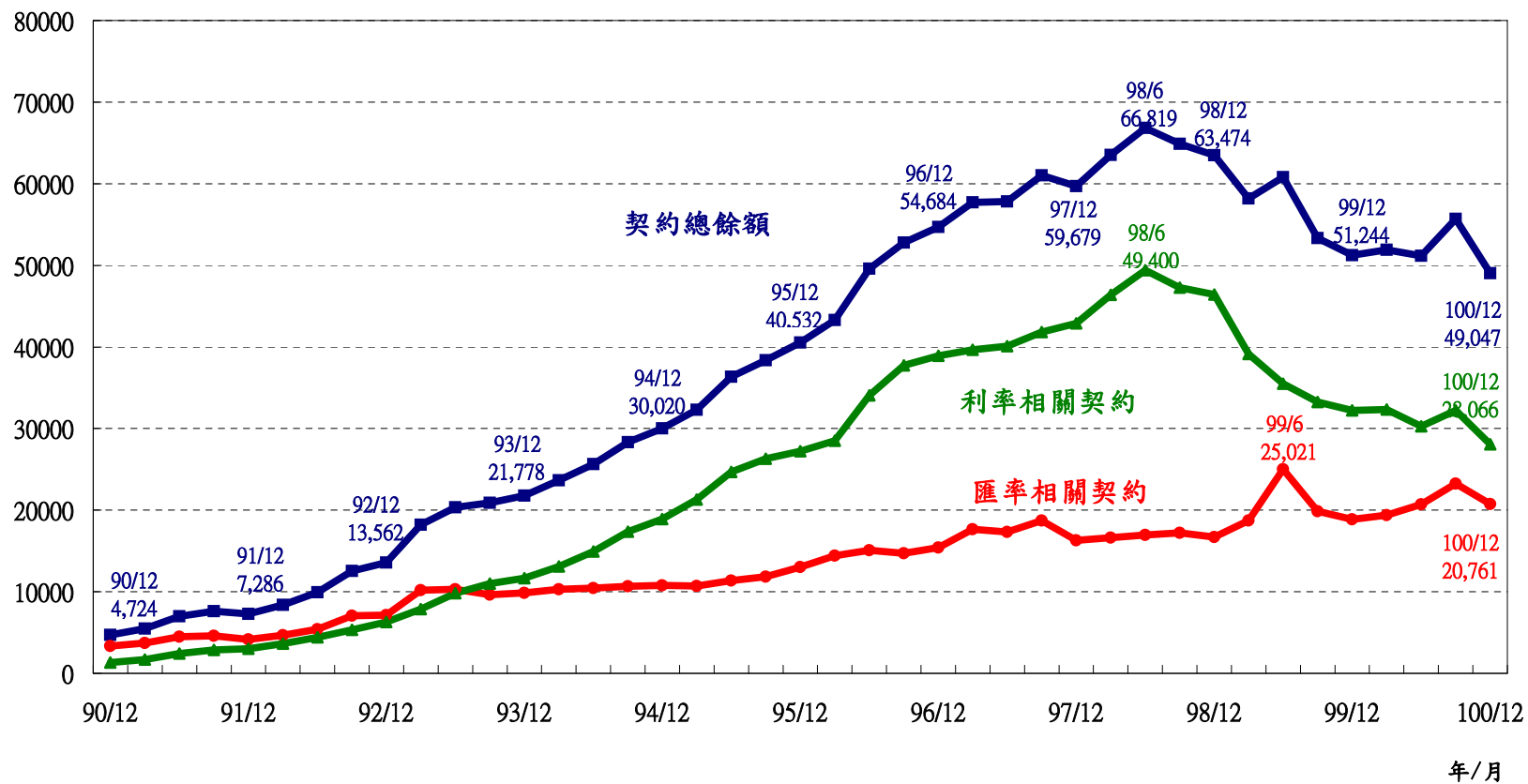
單位：新臺幣百萬元

項 目	100年12月底		100年9月底		比 較 增 減	
	合計	百分比	合計	百分比	合計	百分比
<b>一、名日本金餘額</b>	<b>49,047,225</b>	<b>100.00%</b>	<b>55,691,253</b>	<b>100.00%</b>	<b>-6,644,028</b>	<b>-11.93%</b>
(一)店頭市場(OTC)	48,984,033	99.87%	55,614,539	99.86%	-6,630,506	-11.92%
1. 遠期契約(Forwards)	15,832,820	32.28%	14,592,393	26.20%	1,240,427	8.50%
2. 交換(Swaps)	28,563,383	58.24%	35,452,906	63.66%	-6,889,523	-19.43%
3. 買入選擇權(Bought Options)	2,236,029	4.56%	2,733,935	4.91%	-497,906	-18.21%
4. 賣出選擇權(Sold Options)	2,351,801	4.79%	2,835,305	5.09%	-483,504	-17.05%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	63,192	0.13%	76,714	0.14%	-13,522	-17.63%
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	17,521	0.04%	10,881	0.02%	6,640	61.02%
2. 期貨-短部位(Futures -Short Positions)	39,477	0.08%	48,220	0.09%	-8,743	-18.13%
3. 買入選擇權(Bought Options)	4,727	0.01%	5,493	0.01%	-766	-13.95%
4. 賣出選擇權(Sold Options)	1,467	0.00%	12,120	0.02%	-10,653	-87.90%
<b>二、名日本金餘額</b>	<b>49,047,225</b>	<b>100.00%</b>	<b>55,691,253</b>	<b>100.00%</b>	<b>-6,644,028</b>	<b>-11.93%</b>
(一)交易目的之契約總額	48,727,264	99.35%	55,368,046	99.42%	-6,640,782	-11.99%
(二)非交易目的之契約總額	319,961	0.65%	323,207	0.58%	-3,246	-1.00%

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)及外國銀行(一般分行及國際金融業務分行)。

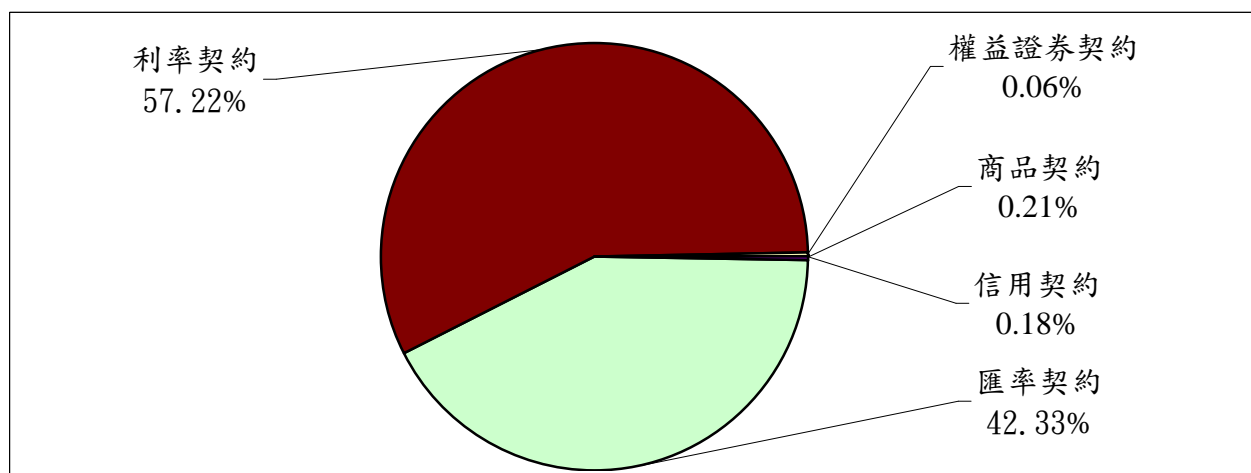
### 銀行辦理衍生性金融商品未結清契約統計(附圖1)

新台幣10億元

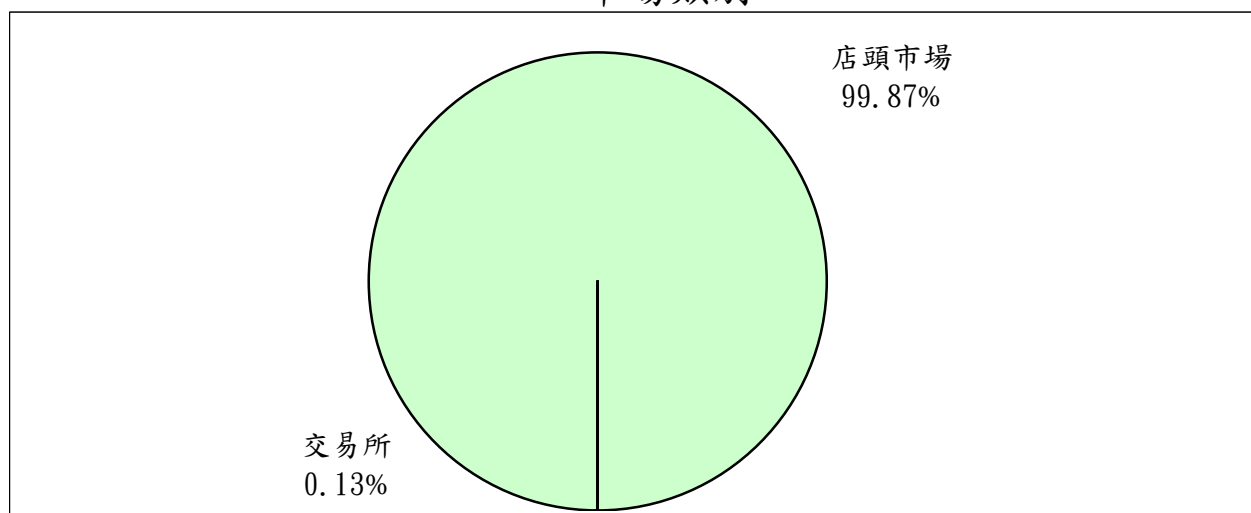


## 100年12月底銀行衍生性金融商品未結清契約內容分析(附圖2)

### 商品種類別



### 市場類別



### 銀行類別

