

附表1 銀行衍生性金融商品未結清契約名目本金餘額

107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)	18,817,465	39,266,995	17,695	6,978	51,615	-	58,160,748	99.31
(一)遠期契約(Forwards)	-	35,723,064	-	491	-	-	35,723,555	60.99
(二)交換(Swaps)	17,474,037	1,811,337	9,932	4,176	51,615	-	19,351,097	33.04
(三)買入選擇權(Bought Options)	205,352	872,344	3,779	974	-	-	1,082,449	1.86
(四)賣出選擇權(Sold Options)	1,138,076	860,250	3,984	1,337	-	-	2,003,647	3.42
二、交易所(Exchange-traded Contracts)	368,074	33,366	9,315	365	-	-	411,120	0.69
(一)期貨-長部位(Futures-Long Positions)	185,733	9,297	387	240	-	-	195,657	0.33
(二)期貨-短部位(Futures-Short Positions)	182,341	15,246	718	92	-	-	198,397	0.34
(三)買入選擇權(Bought Options)	-	4,868	3,865	15	-	-	8,748	0.01
(四)賣出選擇權(Sold Options)	-	3,955	4,345	18	-	-	8,318	0.01
合 計	19,185,539	39,300,361	27,010	7,343	51,615	-	58,571,868	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	18,972,881	39,193,501	27,010	7,343	51,615	-	58,252,350	99.45
二、非交易目的	212,658	106,860	-	-	-	-	319,518	0.55
合 計	19,185,539	39,300,361	27,010	7,343	51,615	-	58,571,868	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；%

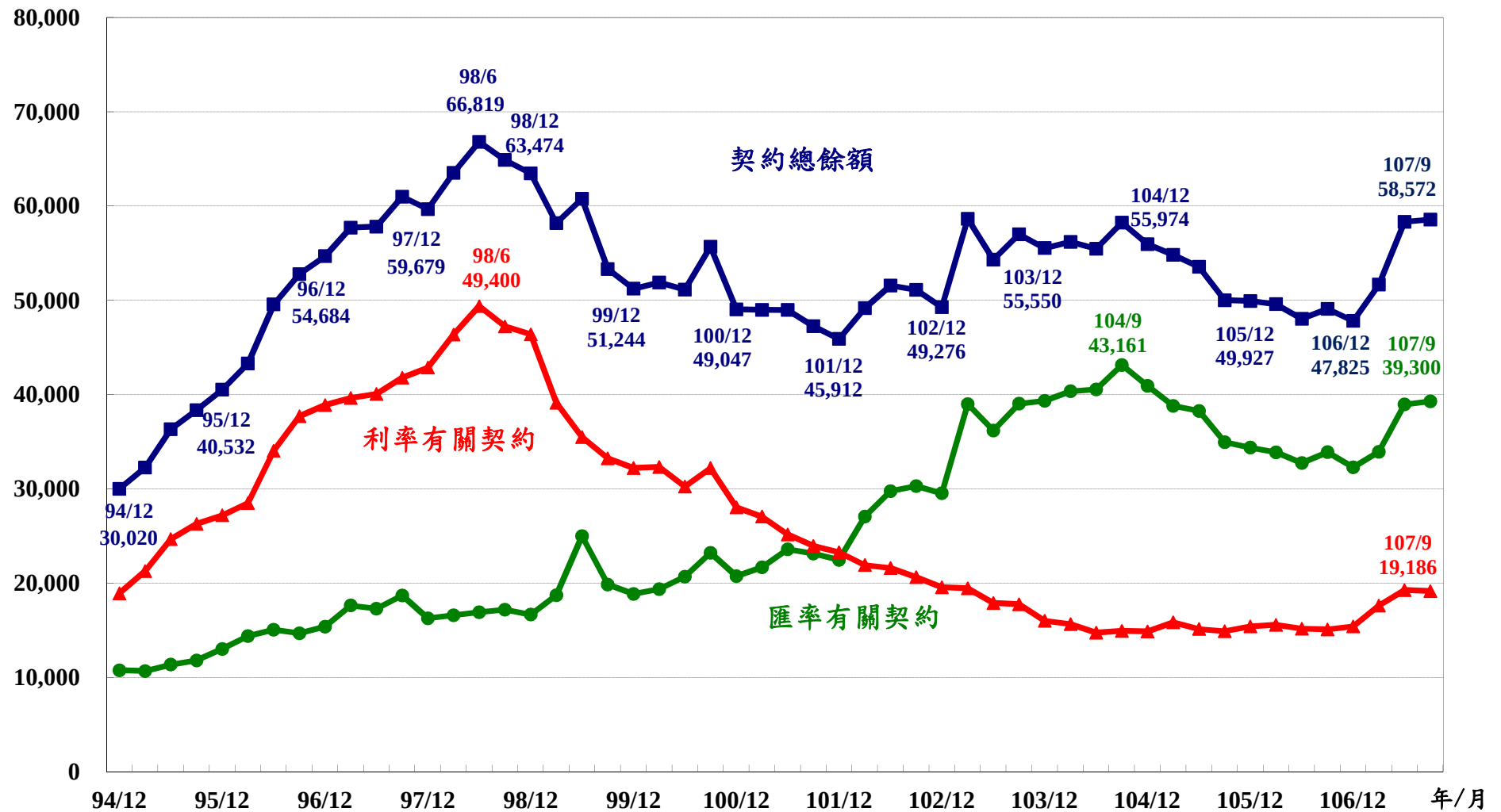
項 目	107年9月底		107年6月底		比較增減	
	金額	比重	金額	比重	金額	變動率
一、店頭市場(OTC)	58,160,748	99.31	57,906,658	99.28	254,090	0.44
(一)遠期契約(Forwards)	35,723,555	60.99	35,685,794	61.18	37,761	0.11
(二)交換(Swaps)	19,351,097	33.04	19,206,951	32.93	144,146	0.75
(三)買入選擇權(Bought Options)	1,082,449	1.86	1,056,701	1.81	25,748	2.44
(四)賣出選擇權(Sold Options)	2,003,647	3.42	1,957,212	3.36	46,435	2.37
二、交易所(Exchange-traded Contracts)	411,120	0.69	424,034	0.72	-12,914	-3.05
(一)期貨-長部位(Futures-Long Positions)	195,657	0.33	155,169	0.27	40,488	26.09
(二)期貨-短部位(Futures-Short Positions)	198,397	0.34	249,898	0.42	-51,501	-20.61
(三)買入選擇權(Bought Options)	8,748	0.01	10,285	0.02	-1,537	-14.94
(四)賣出選擇權(Sold Options)	8,318	0.01	8,682	0.01	-364	-4.19
合 計	58,571,868	100.00	58,330,692	100.00	241,176	0.41

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

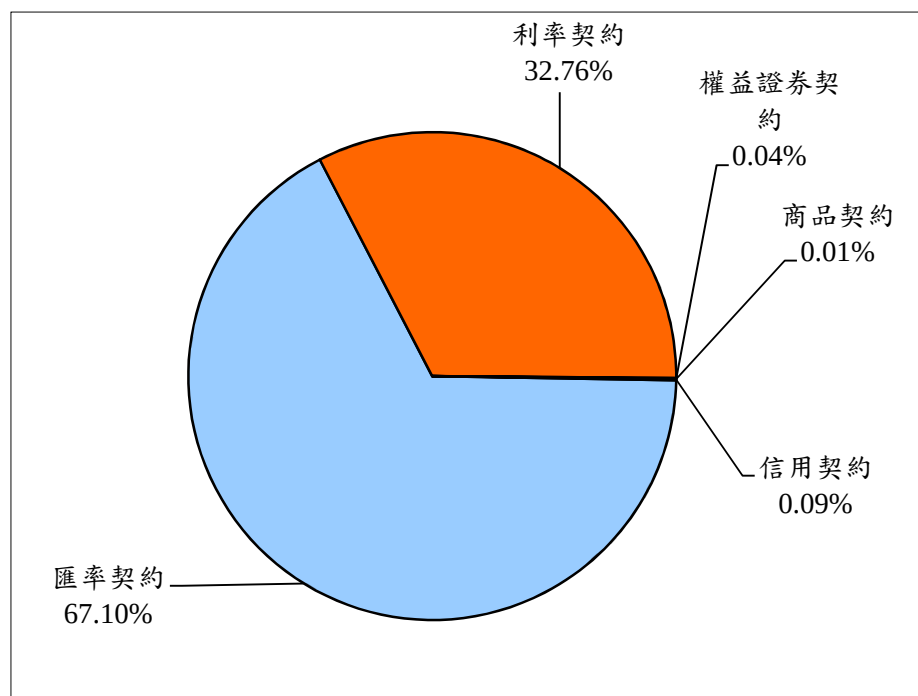
107年9月底



附圖2 銀行衍生性金融商品未結清契約內容分析

107年9月底

風險類別



銀行類別

