

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12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)	15,246,629	32,289,266	14,830	9,495	40,496	-	47,600,716	99.53
(一)遠期契約(Forwards)	-	29,312,487	-	21	-	-	29,312,508	61.29
(二)交換(Swaps)	14,573,583	1,617,666	11,831	7,686	40,496	-	16,251,262	33.98
(三)買入選擇權(Bought Options)	103,299	688,996	1,370	894	-	-	794,559	1.66
(四)賣出選擇權(Sold Options)	569,747	670,117	1,629	894	-	-	1,242,387	2.60
二、交易所(Exchange-traded Contracts)	184,902	26,253	12,497	137	-	-	223,789	0.47
(一)期貨-長部位(Futures-Long Positions)	32,552	8,026	376	25	-	-	40,979	0.09
(二)期貨-短部位(Futures-Short Positions)	152,231	5,789	1,215	102	-	-	159,337	0.32
(三)買入選擇權(Bought Options)	119	7,421	3,297	5	-	-	10,842	0.02
(四)賣出選擇權(Sold Options)	-	5,017	7,609	5	-	-	12,631	0.04
合 計	15,431,531	32,315,519	27,327	9,632	40,496	-	47,824,505	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	15,255,359	32,282,278	27,147	9,632	40,496	-	47,614,912	99.56
二、非交易目的	176,172	33,241	180	-	-	-	209,593	0.44
合 計	15,431,531	32,315,519	27,327	9,632	40,496	-	47,824,505	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；%

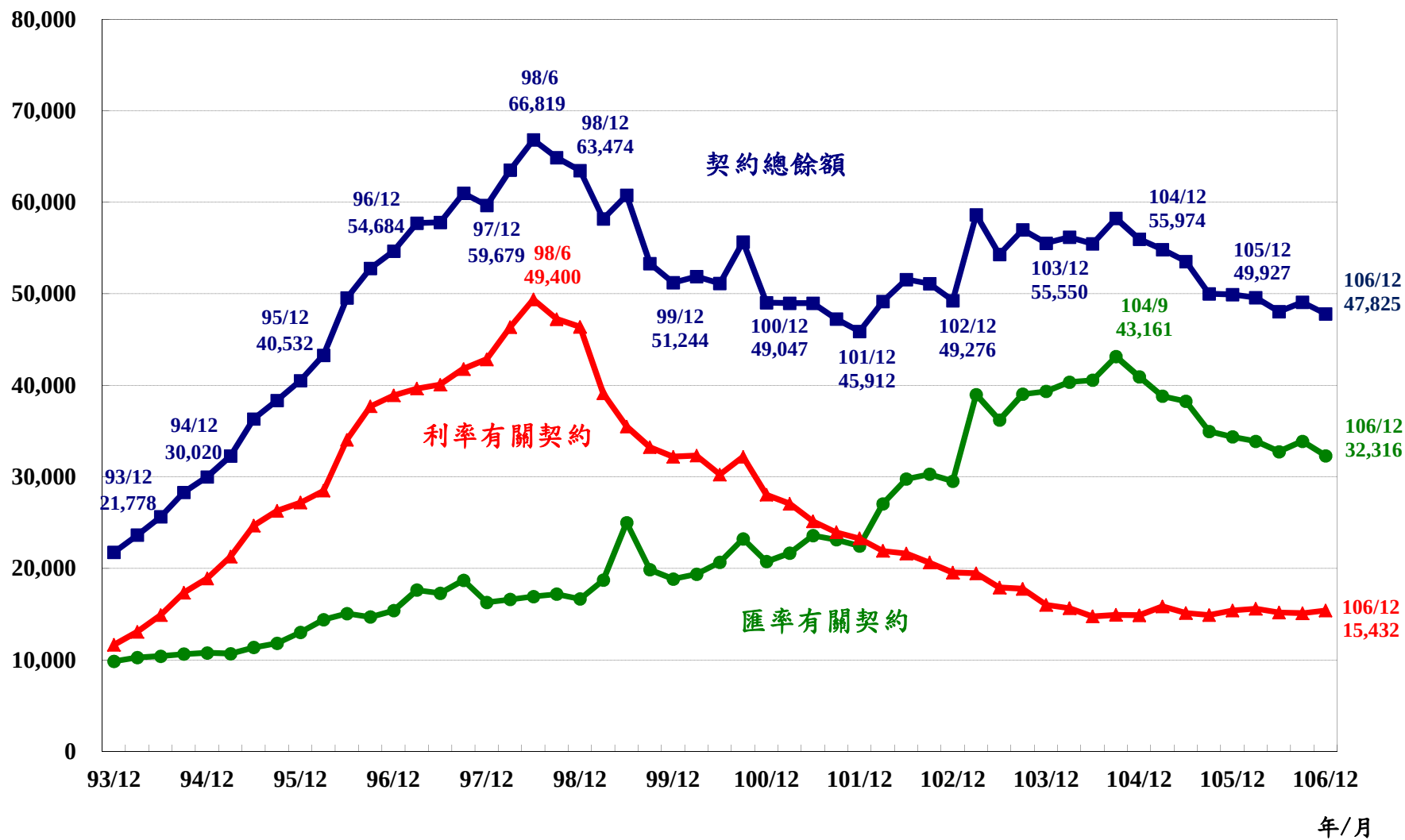
項 目	106年12月底		106年9月底		比較增減	
	金額	比重	金額	比重	金額	變動率
一、店頭市場(OTC)	47,600,716	99.53	48,849,373	99.49	-1,248,657	-2.56
(一)遠期契約(Forwards)	29,312,508	61.29	30,281,274	61.67	-968,766	-3.20
(二)交換(Swaps)	16,251,262	33.98	16,029,974	32.65	221,288	1.38
(三)買入選擇權(Bought Options)	794,559	1.66	1,089,191	2.22	-294,632	-27.05
(四)賣出選擇權(Sold Options)	1,242,387	2.60	1,448,934	2.95	-206,547	-14.26
二、交易所(Exchange-traded Contracts)	223,789	0.47	253,752	0.51	-29,963	-11.81
(一)期貨-長部位(Futures-Long Positions)	40,979	0.09	77,609	0.16	-36,630	-47.20
(二)期貨-短部位(Futures-Short Positions)	159,337	0.32	152,447	0.30	6,890	4.52
(三)買入選擇權(Bought Options)	10,842	0.02	13,173	0.03	-2,331	-17.70
(四)賣出選擇權(Sold Options)	12,631	0.04	10,523	0.02	2,108	20.03
合 計	47,824,505	100.00	49,103,125	100.00	-1,278,620	-2.60

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

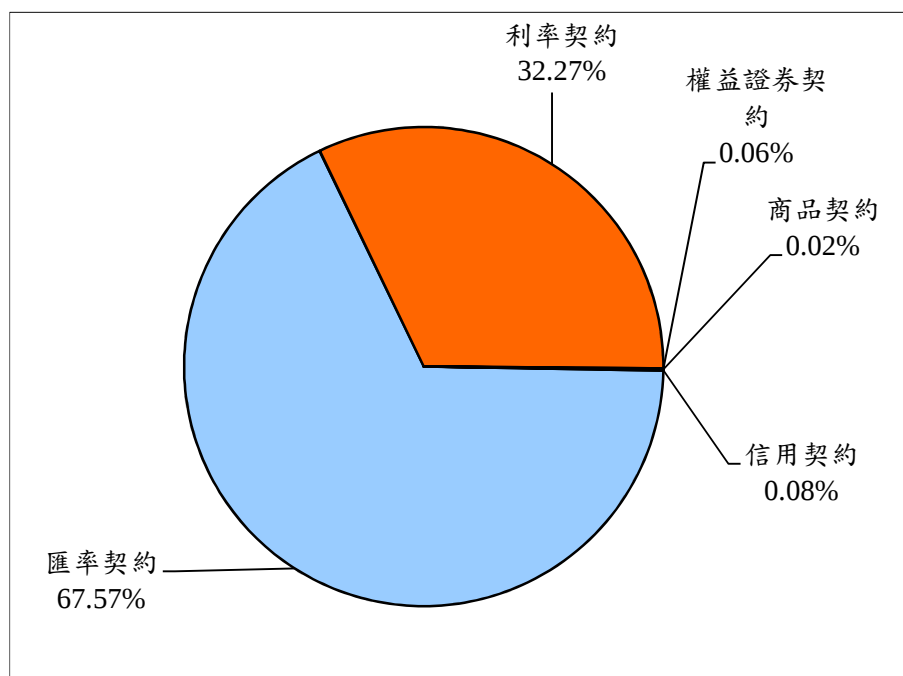
106年12月底



附圖2 銀行衍生性金融商品未結清契約內容分析

106年12月底

風險類別



銀行類別

