

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6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)	15,010,638	32,745,369	16,233	18,086	46,317	-	47,836,643	99.52
(一)遠期契約(Forwards)	-	28,660,690	-	410	-	-	28,661,100	59.63
(二)交換(Swaps)	14,398,999	1,901,441	12,355	12,645	46,317	-	16,371,757	34.06
(三)買入選擇權(Bought Options)	139,068	1,103,903	1,809	1,896	-	-	1,246,676	2.59
(四)賣出選擇權(Sold Options)	472,571	1,079,335	2,069	3,135	-	-	1,557,110	3.24
二、交易所(Exchange-traded Contracts)	188,551	22,272	14,723	395	-	-	225,941	0.48
(一)期貨-長部位(Futures-Long Positions)	74,716	6,771	1,527	75	-	-	83,089	0.17
(二)期貨-短部位(Futures-Short Positions)	113,835	7,402	1,677	294	-	-	123,208	0.27
(三)買入選擇權(Bought Options)	-	3,925	4,720	8	-	-	8,653	0.02
(四)賣出選擇權(Sold Options)	-	4,174	6,799	18	-	-	10,991	0.02
合 計	15,199,189	32,767,641	30,956	18,481	46,317	-	48,062,584	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	15,035,553	32,726,490	30,726	18,481	46,317	-	47,857,567	99.57
二、非交易目的	163,636	41,151	230	-	-	-	205,017	0.43
合 計	15,199,189	32,767,641	30,956	18,481	46,317	-	48,062,584	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；%

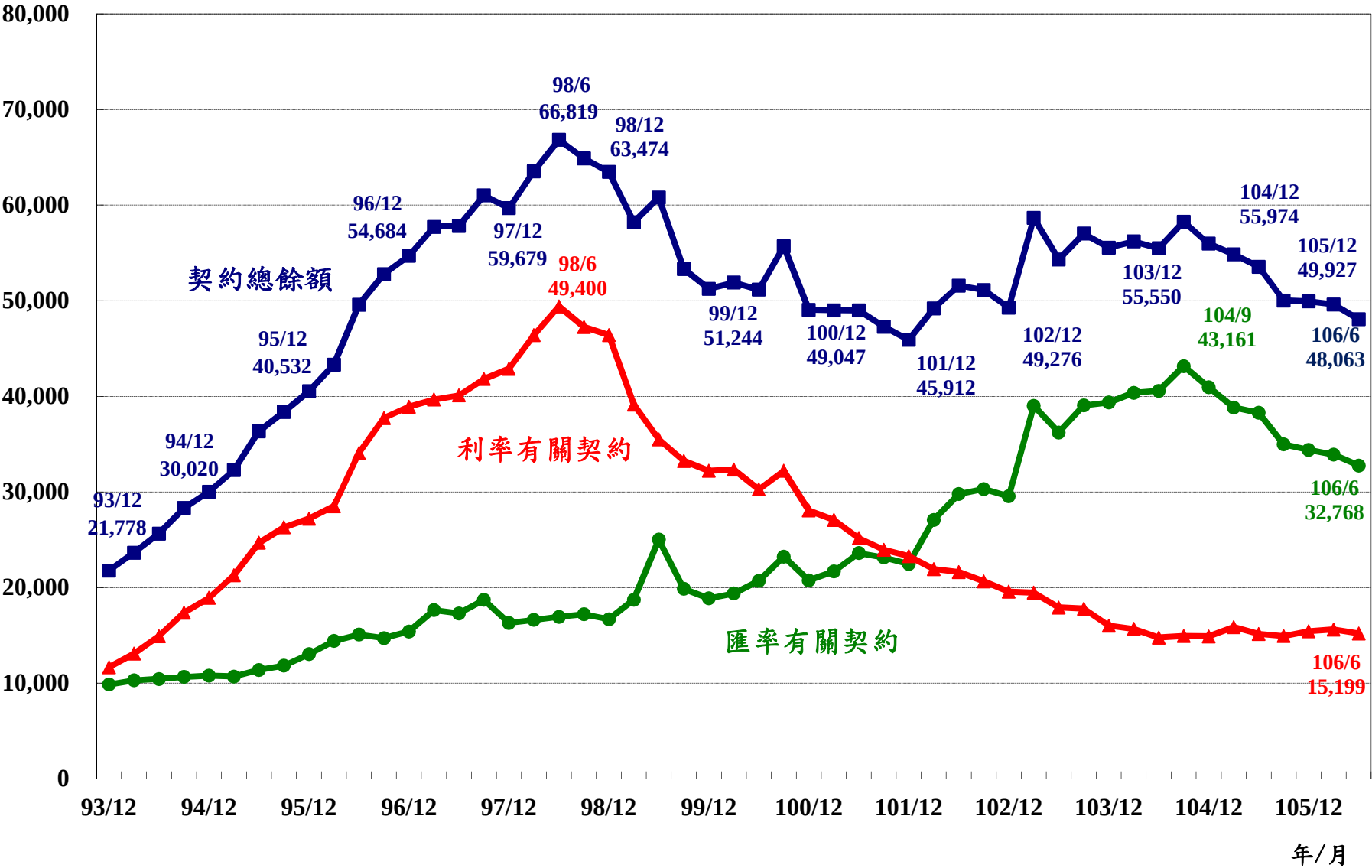
項 目	106年6月底		106年3月底		比較增減	
	金額	比重	金額	比重	金額	變動率
一、店頭市場(OTC)	47,836,643	99.52	49,444,971	99.68	-1,608,328	-3.25
(一)遠期契約(Forwards)	28,661,100	59.63	28,678,705	57.82	-17,605	-0.06
(二)交換(Swaps)	16,371,757	34.06	17,071,549	34.42	-699,792	-4.10
(三)買入選擇權(Bought Options)	1,246,676	2.59	1,697,916	3.42	-451,240	-26.58
(四)賣出選擇權(Sold Options)	1,557,110	3.24	1,996,801	4.02	-439,691	-22.02
二、交易所(Exchange-traded Contracts)	225,941	0.48	158,656	0.32	67,285	42.41
(一)期貨-長部位(Futures-Long Positions)	83,089	0.17	9,051	0.02	74,038	818.01
(二)期貨-短部位(Futures-Short Positions)	123,208	0.27	131,545	0.26	-8,337	-6.34
(三)買入選擇權(Bought Options)	8,653	0.02	9,147	0.02	-494	-5.40
(四)賣出選擇權(Sold Options)	10,991	0.02	8,913	0.02	2,078	23.31
合 計	48,062,584	100.00	49,603,627	100.00	-1,541,043	-3.11

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

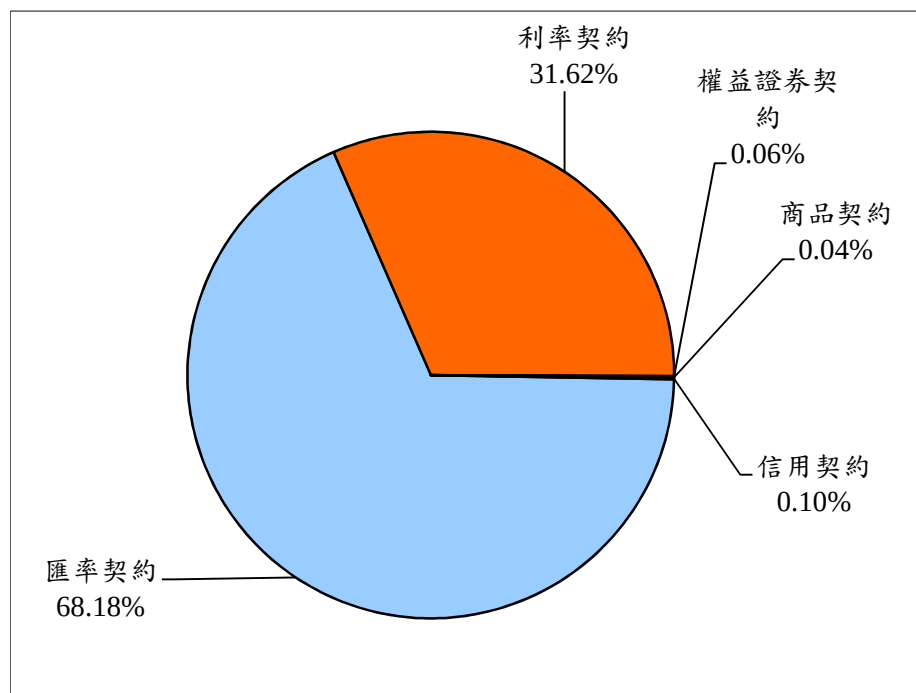
106年6月底



附圖2 銀行衍生性金融商品未結清契約內容分析

106年6月底

風險類別



銀行類別

