

附表1 銀行衍生性金融商品未結清契約名目本金餘額

105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)	14,805,311	34,969,187	21,267	24,436	52,510	-	49,872,711	99.71
(一)遠期契約(Forwards)	-	26,802,121	-	36	-	-	26,802,157	53.58
(二)交換(Swaps)	14,269,285	2,584,373	13,532	15,573	52,510	-	16,935,273	33.86
(三)買入選擇權(Bought Options)	152,954	2,798,007	2,917	3,940	-	-	2,957,818	5.92
(四)賣出選擇權(Sold Options)	383,072	2,784,686	4,818	4,887	-	-	3,177,463	6.35
二、交易所(Exchange-traded Contracts)	122,612	12,902	10,902	1,120	-	-	147,536	0.29
(一)期貨-長部位(Futures-Long Positions)	19,486	3,080	109	395	-	-	23,070	0.05
(二)期貨-短部位(Futures-Short Positions)	103,126	4,779	1,432	573	-	-	109,910	0.22
(三)買入選擇權(Bought Options)	-	2,255	4,532	70	-	-	6,857	0.01
(四)賣出選擇權(Sold Options)	-	2,788	4,829	82	-	-	7,699	0.01
合 計	14,927,923	34,982,089	32,169	25,556	52,510	-	50,020,247	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	14,808,366	34,928,323	31,989	25,556	52,510	-	49,846,744	99.65
二、非交易目的	119,557	53,766	180	-	-	-	173,503	0.35
合 計	14,927,923	34,982,089	32,169	25,556	52,510	-	50,020,247	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；%

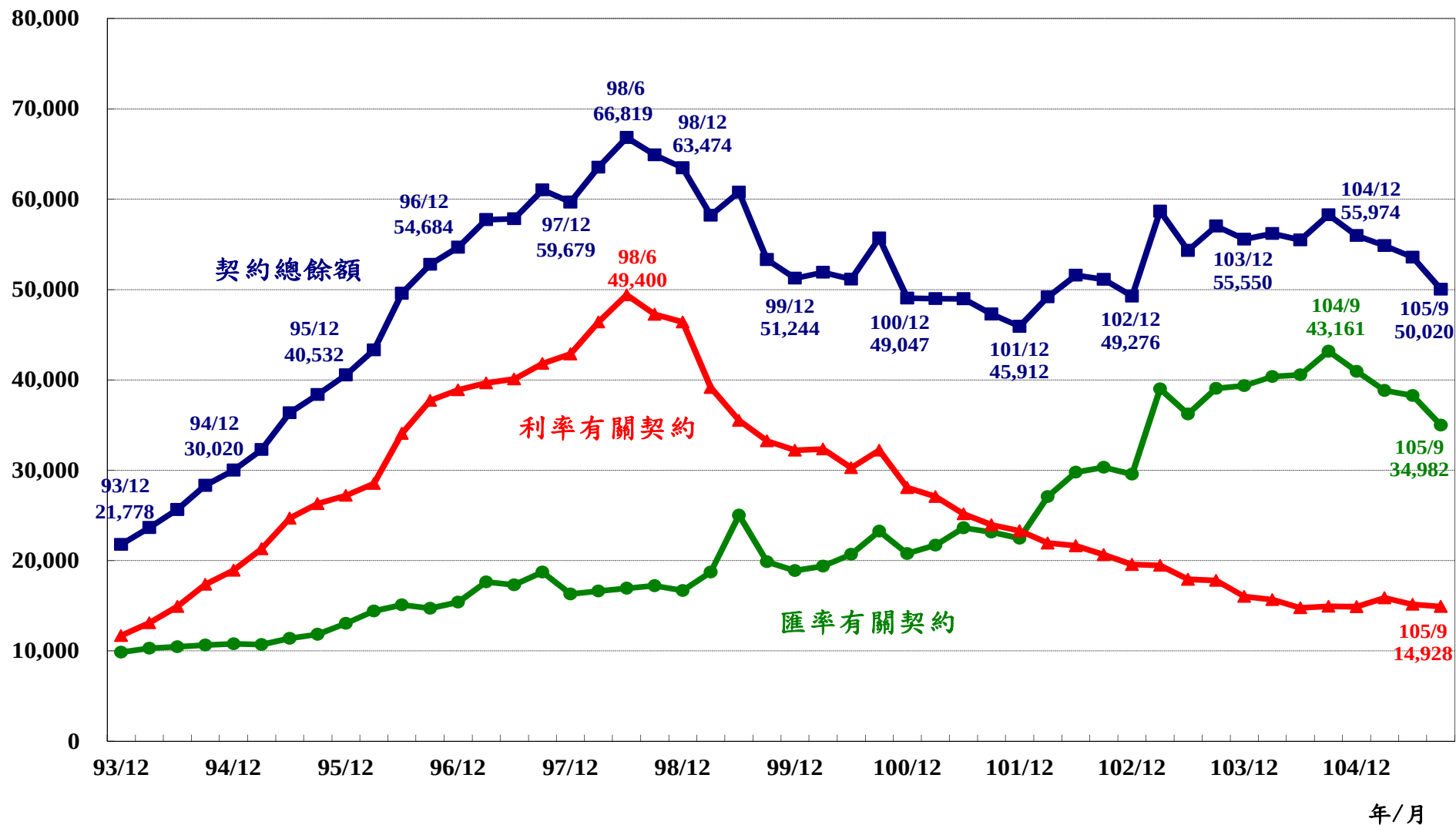
項 目	105年9月底		105年6月底		比較增減	
	金額	比重	金額	比重	金額	變動率
一、店頭市場(OTC)	49,872,711	99.71	53,432,516	99.77	-3,559,805	-6.66
（一）遠期契約(Forwards)	26,802,157	53.58	28,425,477	53.08	-1,623,320	-5.71
（二）交換(Swaps)	16,935,273	33.86	17,115,131	31.96	-179,858	-1.05
（三）買入選擇權(Bought Options)	2,957,818	5.92	3,827,619	7.14	-869,801	-22.72
（四）賣出選擇權(Sold Options)	3,177,463	6.35	4,064,289	7.59	-886,826	-21.82
二、交易所(Exchange-traded Contracts)	147,536	0.29	122,385	0.23	25,151	20.55
（一）期貨-長部位(Futures-Long Positions)	23,070	0.05	15,689	0.03	7,381	47.05
（二）期貨-短部位(Futures-Short Positions)	109,910	0.22	94,603	0.18	15,307	16.18
（三）買入選擇權(Bought Options)	6,857	0.01	5,513	0.01	1,344	24.38
（四）賣出選擇權(Sold Options)	7,699	0.01	6,580	0.01	1,119	17.01
合 計	50,020,247	100.00	53,554,901	100.00	-3,534,654	-6.60

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(在台一般分行及國際金融業務分行)。

新臺幣10億元

附圖1 銀行辦理衍生性金融商品未結清契約統計

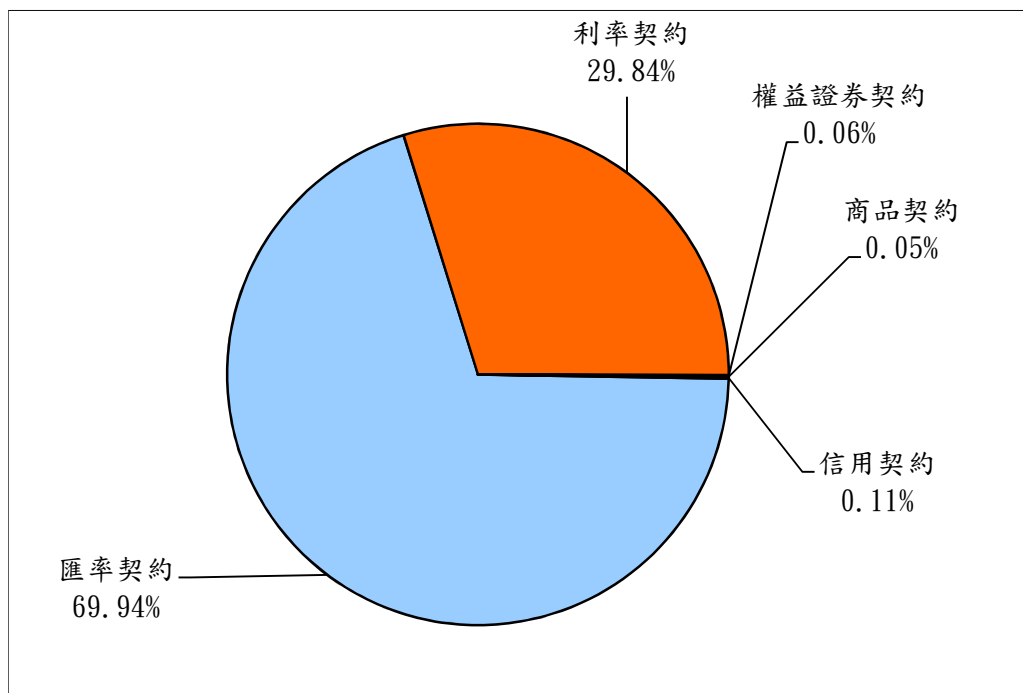
105年9月底



附圖2 銀行衍生性金融商品未結清契約內容分析

105年9月底

風險類別



銀行類別

