

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)	18,892,266	38,938,279	20,520	7,360	48,233	-	57,906,658	99.28
(一)遠期契約(Forwards)	-	35,685,283	-	511	-	-	35,685,794	61.18
(二)交換(Swaps)	17,522,392	1,622,059	10,463	3,804	48,233	-	19,206,951	32.93
(三)買入選擇權(Bought Options)	234,629	816,276	4,926	870	-	-	1,056,701	1.81
(四)賣出選擇權(Sold Options)	1,135,245	814,661	5,131	2,175	-	-	1,957,212	3.36
二、交易所(Exchange-traded Contracts)	380,267	32,450	11,006	311	-	-	424,034	0.72
(一)期貨-長部位(Futures-Long Positions)	143,542	10,792	714	121	-	-	155,169	0.27
(二)期貨-短部位(Futures-Short Positions)	236,725	11,639	1,350	184	-	-	249,898	0.42
(三)買入選擇權(Bought Options)	-	5,412	4,867	6	-	-	10,285	0.02
(四)賣出選擇權(Sold Options)	-	4,607	4,075	-	-	-	8,682	0.01
合 計	19,272,533	38,970,729	31,526	7,671	48,233	-	58,330,692	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	19,072,795	38,909,214	31,526	7,671	48,233	-	58,069,439	99.55
二、非交易目的	199,738	61,515	-	-	-	-	261,253	0.45
合 計	19,272,533	38,970,729	31,526	7,671	48,233	-	58,330,692	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；%

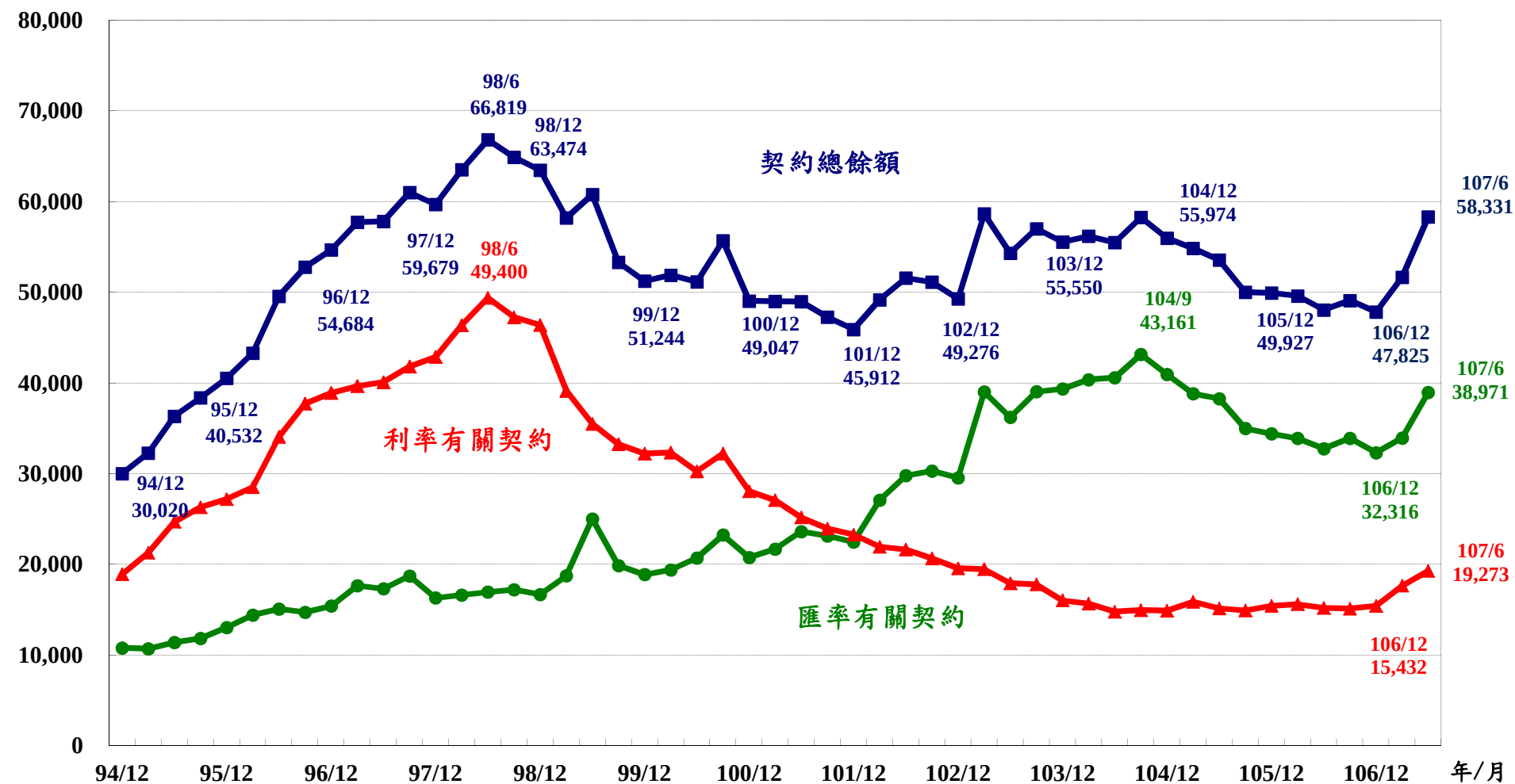
項 目	107年6月底		107年3月底		比較增減	
	金額	比重	金額	比重	金額	變動率
一、店頭市場(OTC)	57,906,658	99.28	51,280,269	99.25	6,626,389	12.92
(一)遠期契約(Forwards)	35,685,794	61.18	30,899,917	59.80	4,785,877	15.49
(二)交換(Swaps)	19,206,951	32.93	17,619,021	34.10	1,587,930	9.01
(三)買入選擇權(Bought Options)	1,056,701	1.81	980,174	1.90	76,527	7.81
(四)賣出選擇權(Sold Options)	1,957,212	3.36	1,781,157	3.45	176,055	9.88
二、交易所(Exchange-traded Contracts)	424,034	0.72	392,816	0.75	31,218	7.95
(一)期貨-長部位(Futures-Long Positions)	155,169	0.27	155,463	0.30	-294	-0.19
(二)期貨-短部位(Futures-Short Positions)	249,898	0.42	215,222	0.41	34,676	16.11
(三)買入選擇權(Bought Options)	10,285	0.02	10,921	0.02	-636	-5.82
(四)賣出選擇權(Sold Options)	8,682	0.01	11,210	0.02	-2,528	-22.55
合 計	58,330,692	100.00	51,673,085	100.00	6,657,607	12.88

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)。

新臺幣10億元

附圖1 銀行衍生性金融商品未結清契約統計

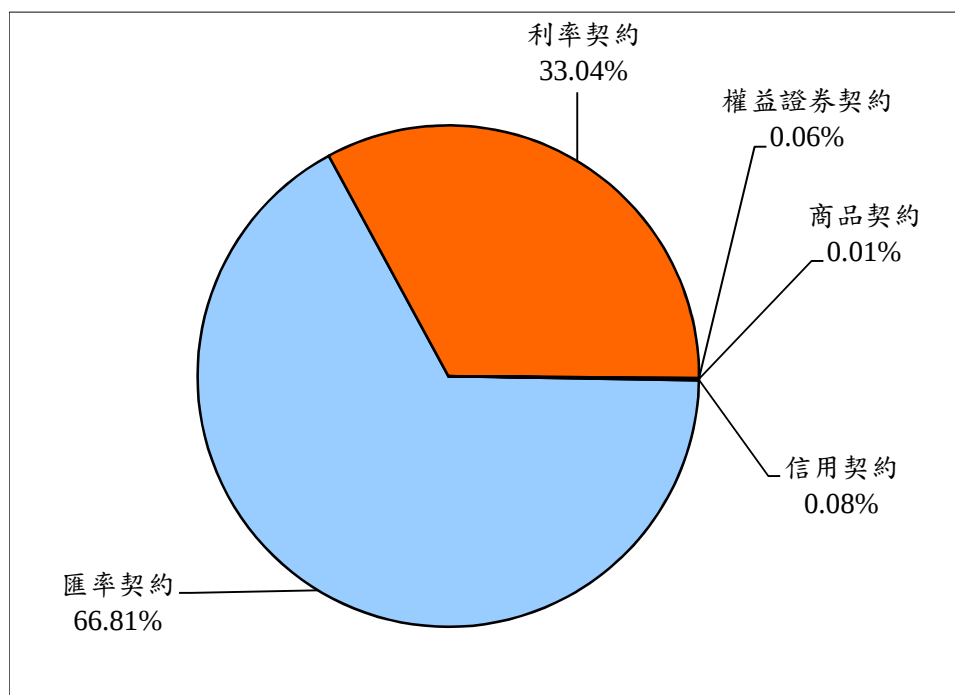
107年6月底



附圖2 銀行衍生性金融商品未結清契約內容分析

107年6月底

風險類別



銀行類別

