

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3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)	15,807,636	38,814,960	34,970	37,968	57,379	-	54,752,913	99.84
(一)遠期契約(Forwards)	96,840	27,713,160	-	135	-	-	27,810,135	50.71
(二)交換(Swaps)	15,193,764	2,211,382	15,317	16,796	57,379	-	17,494,638	31.90
(三)買入選擇權(Bought Options)	173,078	4,454,166	3,186	10,415	-	-	4,640,845	8.46
(四)賣出選擇權(Sold Options)	343,954	4,436,252	16,467	10,622	-	-	4,807,295	8.77
二、交易所(Exchange-traded Contracts)	57,573	10,764	21,257	644	-	-	90,238	0.16
(一)期貨-長部位(Futures-Long Positions)	5,163	5,109	457	236	-	-	10,965	0.02
(二)期貨-短部位(Futures-Short Positions)	52,410	5,655	1,814	257	-	-	60,136	0.11
(三)買入選擇權(Bought Options)	-	-	6,793	82	-	-	6,875	0.01
(四)賣出選擇權(Sold Options)	-	-	12,193	69	-	-	12,262	0.02
合 計	15,865,209	38,825,724	56,227	38,612	57,379	-	54,843,151	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	15,739,488	38,780,192	44,788	38,612	57,379	-	54,660,459	99.67
二、非交易目的	125,721	45,532	11,439	-	-	-	182,692	0.33
合 計	15,865,209	38,825,724	56,227	38,612	57,379	-	54,843,151	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；%

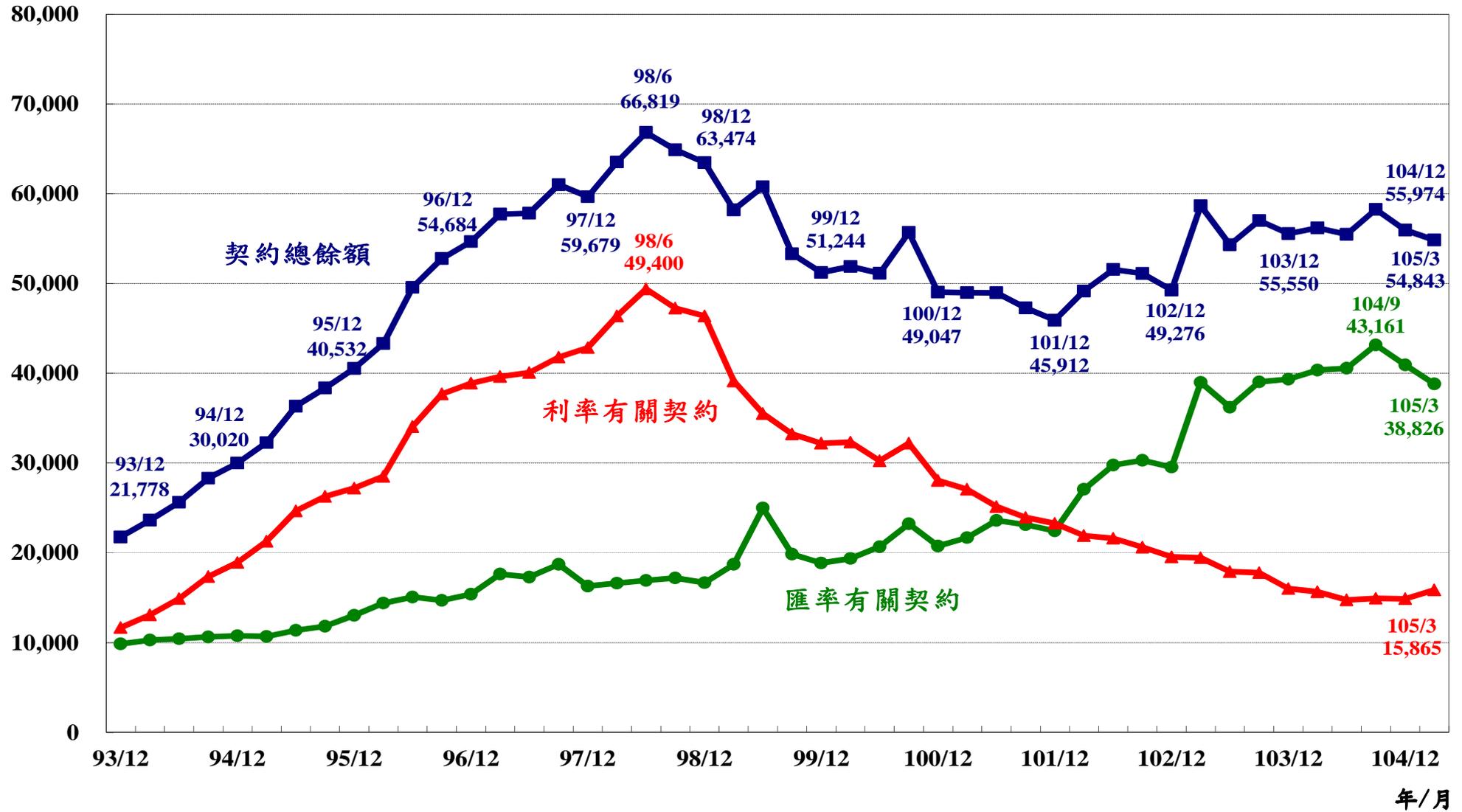
項 目	105年3月底		104年12月底		比較增減	
	金額	比重	金額	比重	金額	變動率
一、店頭市場(OTC)	54,752,913	99.84	55,898,779	99.87	-1,145,866	-2.05
(一)遠期契約(Forwards)	27,810,135	50.71	27,946,184	49.93	-136,049	-0.49
(二)交換(Swaps)	17,494,638	31.90	16,584,172	29.63	910,466	5.49
(三)買入選擇權(Bought Options)	4,640,845	8.46	5,610,104	10.02	-969,259	-17.28
(四)賣出選擇權(Sold Options)	4,807,295	8.77	5,758,319	10.29	-951,024	-16.52
二、交易所(Exchange-traded Contracts)	90,238	0.16	75,160	0.13	15,078	20.06
(一)期貨-長部位(Futures-Long Positions)	10,965	0.02	7,714	0.01	3,251	42.14
(二)期貨-短部位(Futures-Short Positions)	60,136	0.11	54,992	0.10	5,144	9.35
(三)買入選擇權(Bought Options)	6,875	0.01	6,135	0.01	740	12.06
(四)賣出選擇權(Sold Options)	12,262	0.02	6,319	0.01	5,943	94.05
合 計	54,843,151	100.00	55,973,939	100.00	-1,130,788	-2.02

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)。

附圖1 銀行辦理衍生性金融商品未結清契約統計

新臺幣10億元

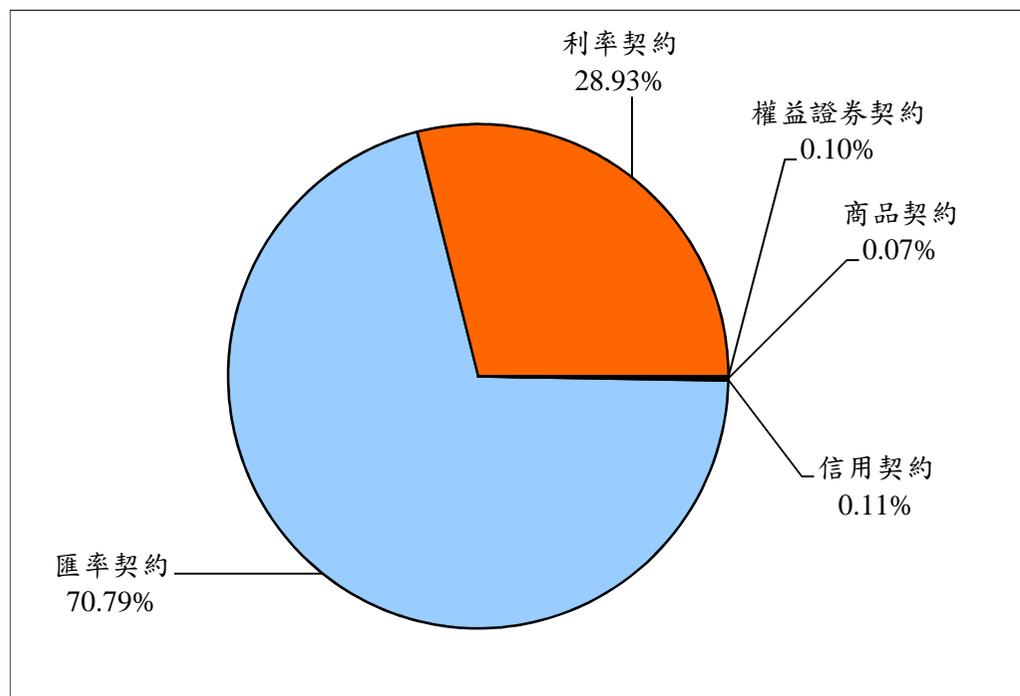
105年3月底



附圖2 銀行衍生性金融商品未結清契約內容分析

105年3月底

風險類別



銀行類別

