

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)	15,328,222	34,379,151	20,036	22,341	52,645	-	49,802,395	99.75
(一)遠期契約(Forwards)	3,874	27,895,135	-	190	-	-	27,899,199	55.88
(二)交換(Swaps)	14,779,116	2,492,775	13,723	15,412	52,645	-	17,353,671	34.76
(三)買入選擇權(Bought Options)	175,884	1,993,723	2,085	3,300	-	-	2,174,992	4.36
(四)賣出選擇權(Sold Options)	369,348	1,997,518	4,228	3,439	-	-	2,374,533	4.75
二、交易所(Exchange-traded Contracts)	101,686	16,841	6,197	351	-	-	125,075	0.25
(一)期貨-長部位(Futures-Long Positions)	47,046	4,367	302	83	-	-	51,798	0.11
(二)期貨-短部位(Futures-Short Positions)	54,317	5,642	554	255	-	-	60,768	0.12
(三)買入選擇權(Bought Options)	323	3,263	3,024	6	-	-	6,616	0.01
(四)賣出選擇權(Sold Options)	-	3,569	2,317	7	-	-	5,893	0.01
合 計	15,429,908	34,395,992	26,233	22,692	52,645	-	49,927,470	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	15,305,051	34,345,093	26,053	22,692	52,645	-	49,751,534	99.65
二、非交易目的	124,857	50,899	180	-	-	-	175,936	0.35
合 計	15,429,908	34,395,992	26,233	22,692	52,645	-	49,927,470	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；%

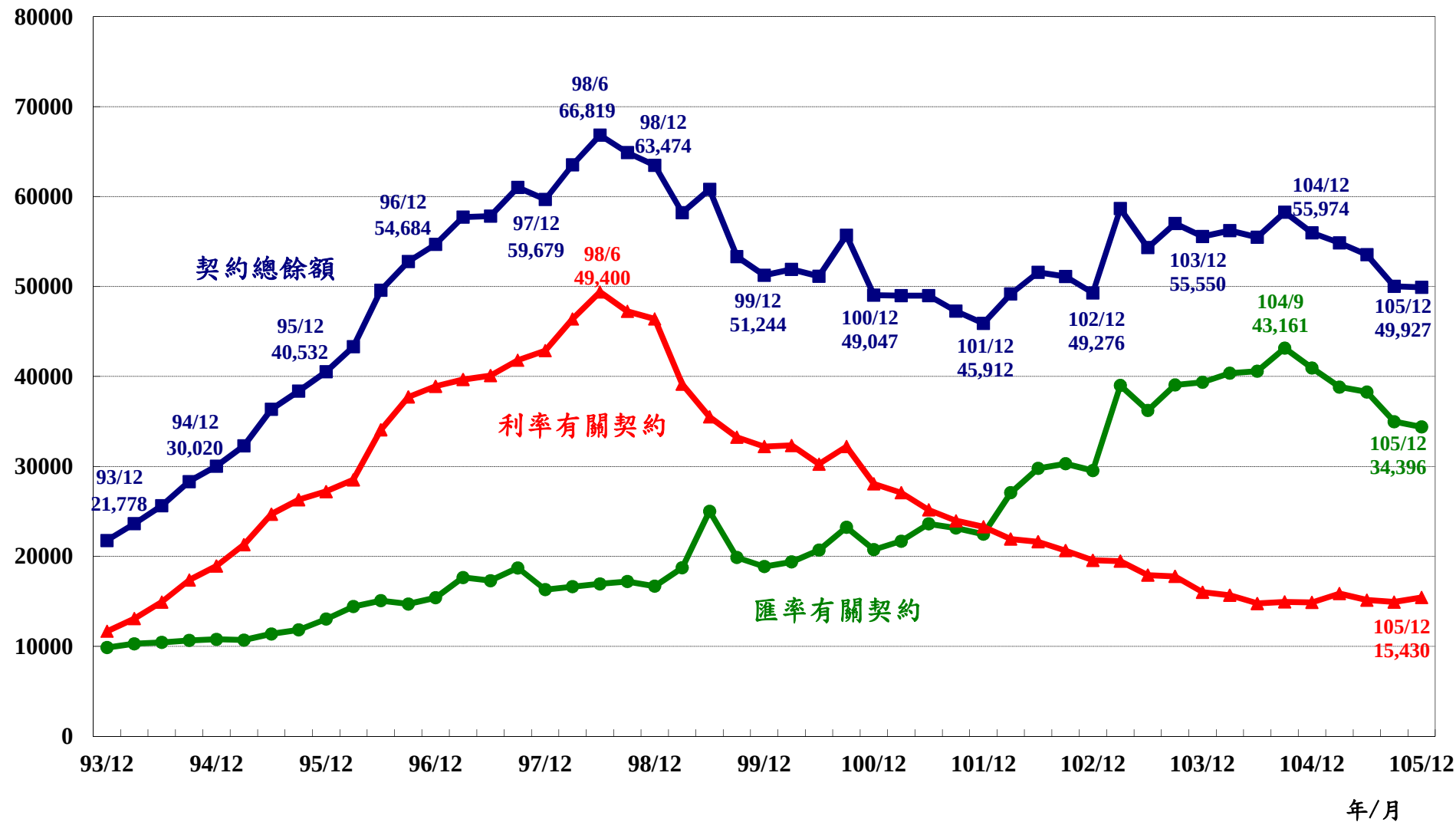
項 目	105年12月底		105年9月底		比較增減	
	金額	比重	金額	比重	金額	變動率
一、店頭市場(OTC)	49,802,395	99.75	49,872,711	99.71	-70,316	-0.14
（一）遠期契約(Forwards)	27,899,199	55.88	26,802,157	53.58	1,097,042	4.09
（二）交換(Swaps)	17,353,671	34.76	16,935,273	33.86	418,398	2.47
（三）買入選擇權(Bought Options)	2,174,992	4.36	2,957,818	5.92	-782,826	-26.47
（四）賣出選擇權(Sold Options)	2,374,533	4.75	3,177,463	6.35	-802,930	-25.27
二、交易所(Exchange-traded Contracts)	125,075	0.25	147,536	0.29	-22,461	-15.22
（一）期貨-長部位(Futures-Long Positions)	51,798	0.11	23,070	0.05	28,728	124.53
（二）期貨-短部位(Futures-Short Positions)	60,768	0.12	109,910	0.22	-49,142	-44.71
（三）買入選擇權(Bought Options)	6,616	0.01	6,857	0.01	-241	-3.51
（四）賣出選擇權(Sold Options)	5,893	0.01	7,699	0.01	-1,806	-23.46
合 計	49,927,470	100.00	50,020,247	100.00	-92,777	-0.19

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

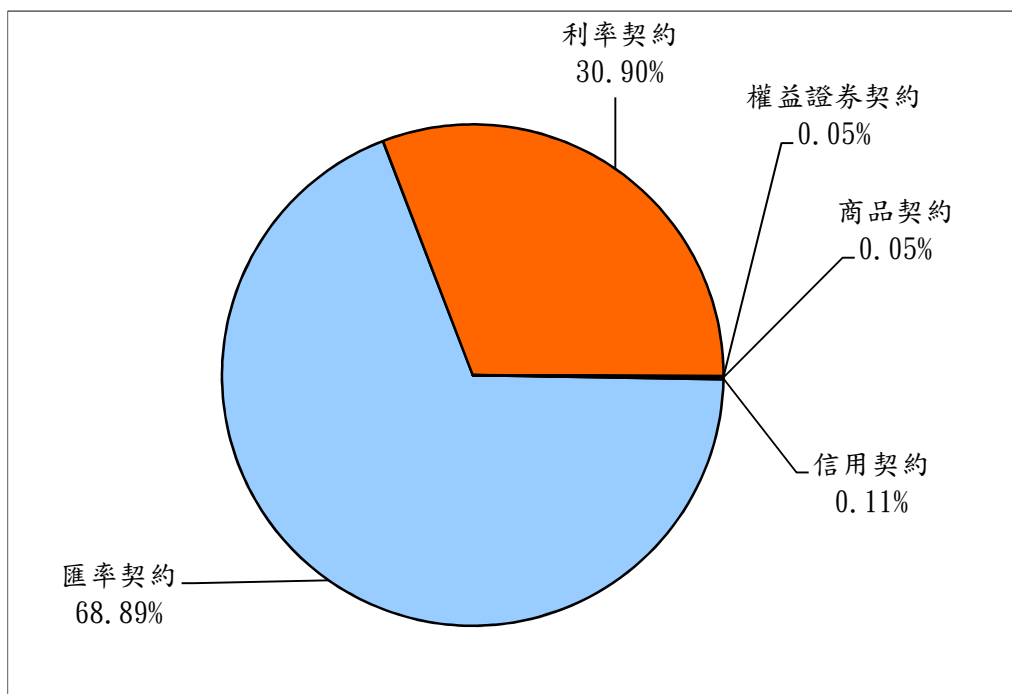
105年12月底



附圖2 銀行衍生性金融商品未結清契約內容分析

105年12月底

風險類別



銀行類別

