

附表1 銀行衍生性金融商品未結清契約名目本金餘額

104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)	14,841,810	40,937,577	24,383	45,982	49,027	-	55,898,779	99.87
(一)遠期契約(Forwards)	99,198	27,846,685	-	301	-	-	27,946,184	49.93
(二)交換(Swaps)	14,249,004	2,251,988	15,983	18,170	49,027	-	16,584,172	29.63
(三)買入選擇權(Bought Options)	162,830	5,430,967	2,670	13,637	-	-	5,610,104	10.02
(四)賣出選擇權(Sold Options)	330,778	5,407,937	5,730	13,874	-	-	5,758,319	10.29
二、交易所(Exchange-traded Contracts)	48,343	12,977	13,695	145	-	-	75,160	0.13
(一)期貨-長部位(Futures-Long Positions)	3,917	3,326	387	84	-	-	7,714	0.01
(二)期貨-短部位(Futures-Short Positions)	44,426	9,651	903	12	-	-	54,992	0.10
(三)買入選擇權(Bought Options)	-	-	6,097	38	-	-	6,135	0.01
(四)賣出選擇權(Sold Options)	-	-	6,308	11	-	-	6,319	0.01
合 計	14,890,153	40,950,554	38,078	46,127	49,027	-	55,973,939	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	14,738,768	40,891,721	37,928	46,127	49,027	-	55,763,571	99.62
二、非交易目的	151,385	58,833	150	-	-	-	210,368	0.38
合 計	14,890,153	40,950,554	38,078	46,127	49,027	-	55,973,939	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；%

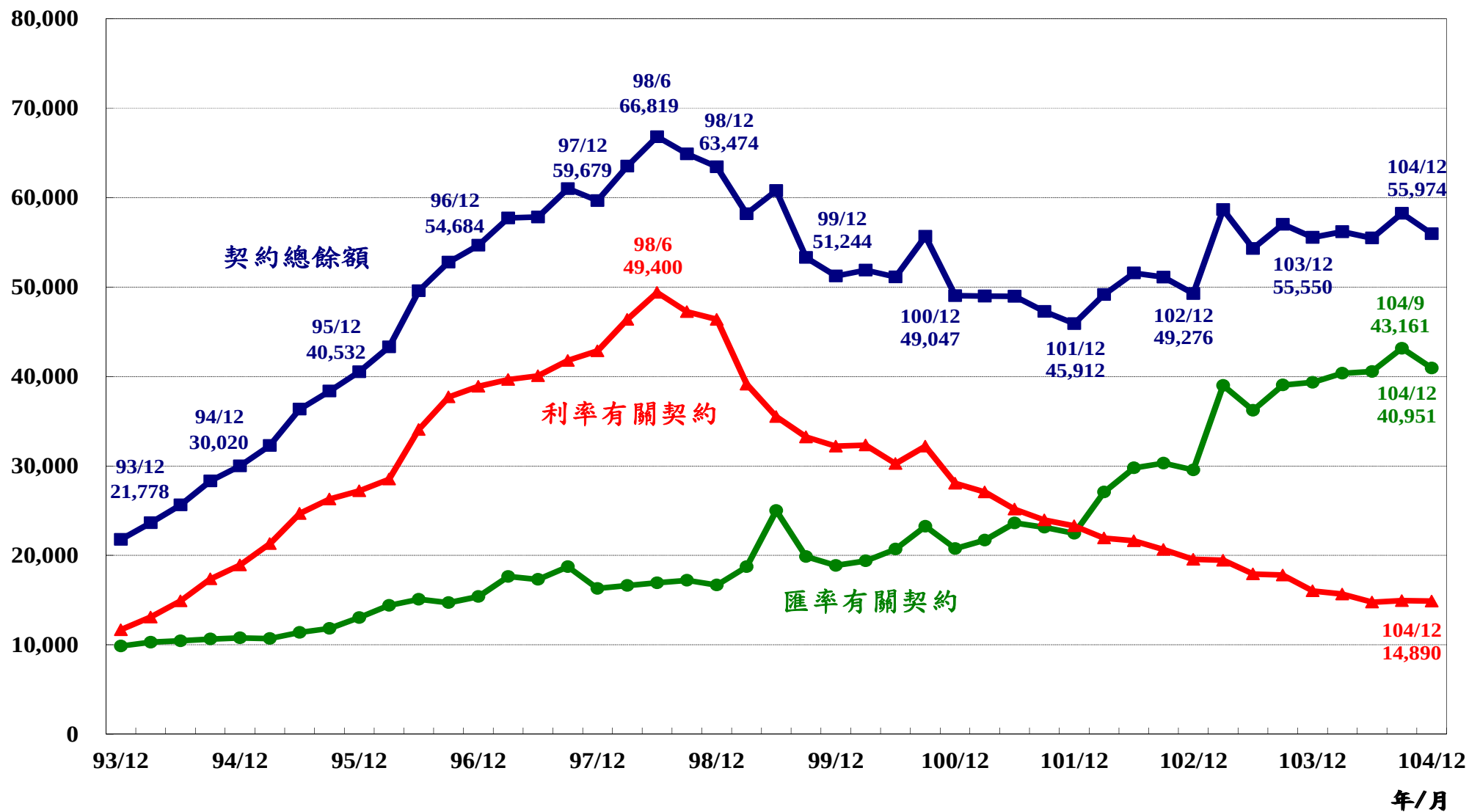
項 目	104年12月底		104年9月底		比較增減	
	金額	比重	金額	比重	金額	變動率
一、店頭市場(OTC)	55,898,779	99.87	58,182,328	99.87	-2,283,549	-3.92
（一）遠期契約(Forwards)	27,946,184	49.93	27,403,538	47.04	542,646	1.98
（二）交換(Swaps)	16,584,172	29.63	16,623,926	28.53	-39,754	-0.24
（三）買入選擇權(Bought Options)	5,610,104	10.02	6,979,069	11.98	-1,368,965	-19.62
（四）賣出選擇權(Sold Options)	5,758,319	10.29	7,175,795	12.32	-1,417,476	-19.75
二、交易所(Exchange-traded Contracts)	75,160	0.13	77,009	0.13	-1,849	-2.40
（一）期貨-長部位(Futures-Long Positions)	7,714	0.01	5,789	0.01	1,925	33.25
（二）期貨-短部位(Futures-Short Positions)	54,992	0.10	56,453	0.10	-1,461	-2.59
（三）買入選擇權(Bought Options)	6,135	0.01	8,062	0.01	-1,927	-23.90
（四）賣出選擇權(Sold Options)	6,319	0.01	6,705	0.01	-386	-5.76
合 計	55,973,939	100.00	58,259,337	100.00	-2,285,398	-3.92

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)及外國銀行(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

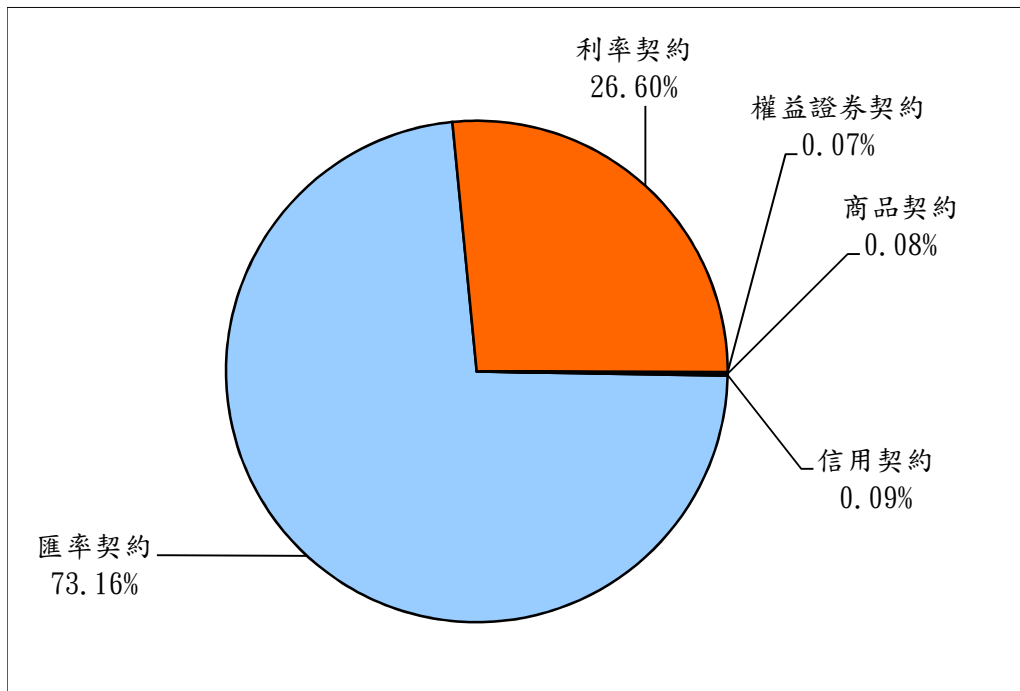
104年12月底



附圖2 銀行衍生性金融商品未結清契約內容分析

104年12月底

風險類別



銀行類別

