

附表1 銀行衍生性金融商品未結清契約名目本金餘額

106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)	15,476,593	33,883,709	16,746	23,556	44,367	-	49,444,971	99.68
(一)遠期契約(Forwards)	-	28,678,285	-	420	-	-	28,678,705	57.82
(二)交換(Swaps)	14,854,488	2,142,447	12,535	17,712	44,367	-	17,071,549	34.42
(三)買入選擇權(Bought Options)	151,965	1,541,892	1,893	2,166	-	-	1,697,916	3.42
(四)賣出選擇權(Sold Options)	470,140	1,521,085	2,318	3,258	-	-	1,996,801	4.02
二、交易所(Exchange-traded Contracts)	129,552	18,324	10,516	264	-	-	158,656	0.32
(一)期貨-長部位(Futures-Long Positions)	3,156	4,611	1,248	36	-	-	9,051	0.02
(二)期貨-短部位(Futures-Short Positions)	126,396	4,411	543	195	-	-	131,545	0.26
(三)買入選擇權(Bought Options)	-	4,200	4,943	4	-	-	9,147	0.02
(四)賣出選擇權(Sold Options)	-	5,102	3,782	29	-	-	8,913	0.02
合 計	15,606,145	33,902,033	27,262	23,820	44,367	-	49,603,627	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	15,450,126	33,853,414	26,941	23,820	44,367	-	49,398,668	99.59
二、非交易目的	156,019	48,619	321	-	-	-	204,959	0.41
合 計	15,606,145	33,902,033	27,262	23,820	44,367	-	49,603,627	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；%

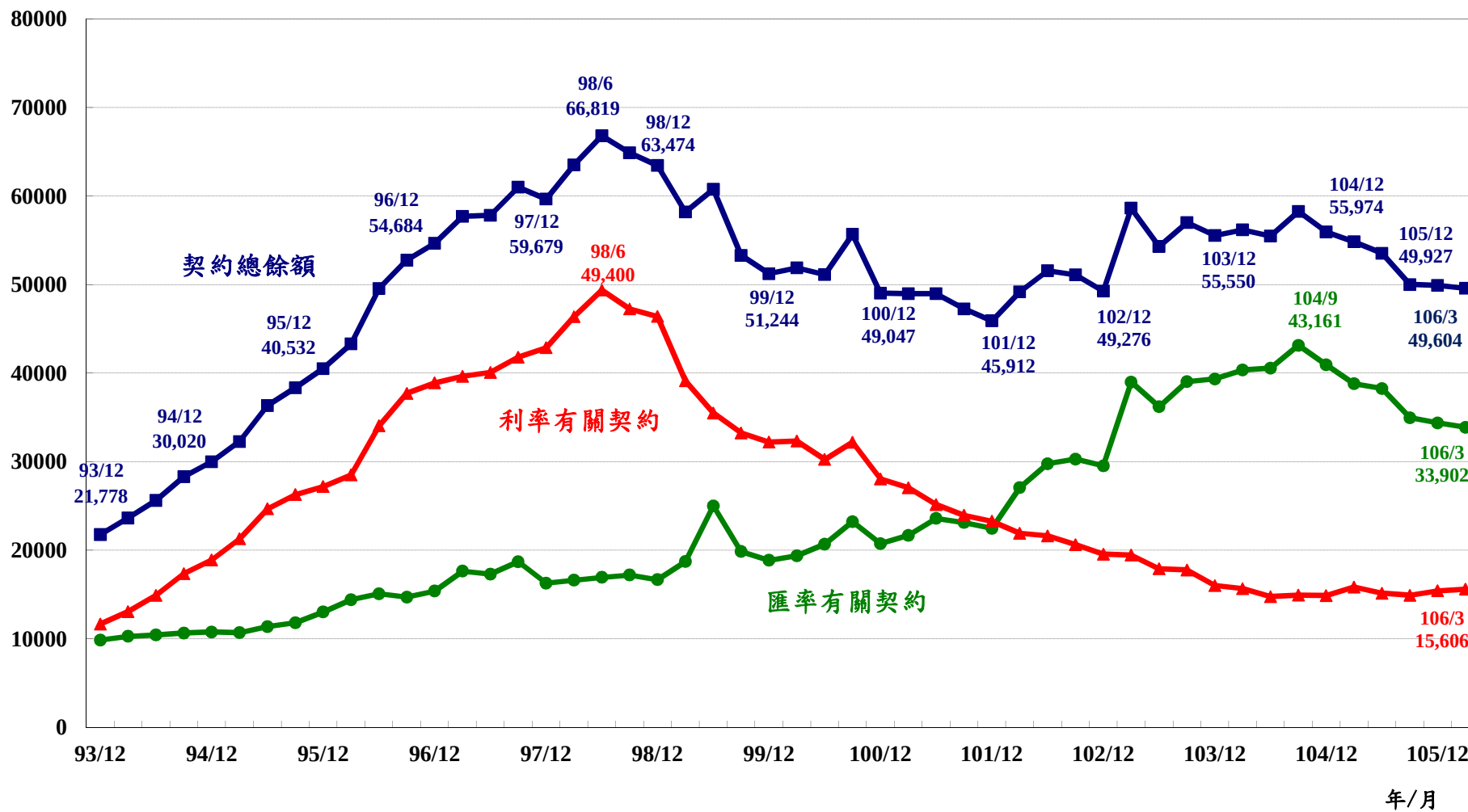
項 目	106年3月底		105年12月底		比較增減	
	金額	比重	金額	比重	金額	變動率
一、店頭市場(OTC)	49,444,971	99.68	49,802,395	99.75	-357,424	-0.72
(一)遠期契約(Forwards)	28,678,705	57.82	27,899,199	55.88	779,506	2.79
(二)交換(Swaps)	17,071,549	34.42	17,353,671	34.76	-282,122	-1.63
(三)買入選擇權(Bought Options)	1,697,916	3.42	2,174,992	4.36	-477,076	-21.93
(四)賣出選擇權(Sold Options)	1,996,801	4.02	2,374,533	4.75	-377,732	-15.91
二、交易所(Exchange-traded Contracts)	158,656	0.32	125,075	0.25	33,581	26.85
(一)期貨-長部位(Futures-Long Positions)	9,051	0.02	51,798	0.11	-42,747	-82.53
(二)期貨-短部位(Futures-Short Positions)	131,545	0.26	60,768	0.12	70,777	116.47
(三)買入選擇權(Bought Options)	9,147	0.02	6,616	0.01	2,531	38.26
(四)賣出選擇權(Sold Options)	8,913	0.02	5,893	0.01	3,020	51.25
合 計	49,603,627	100.00	49,927,470	100.00	-323,843	-0.65

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 銀行辦理衍生性金融商品未結清契約統計

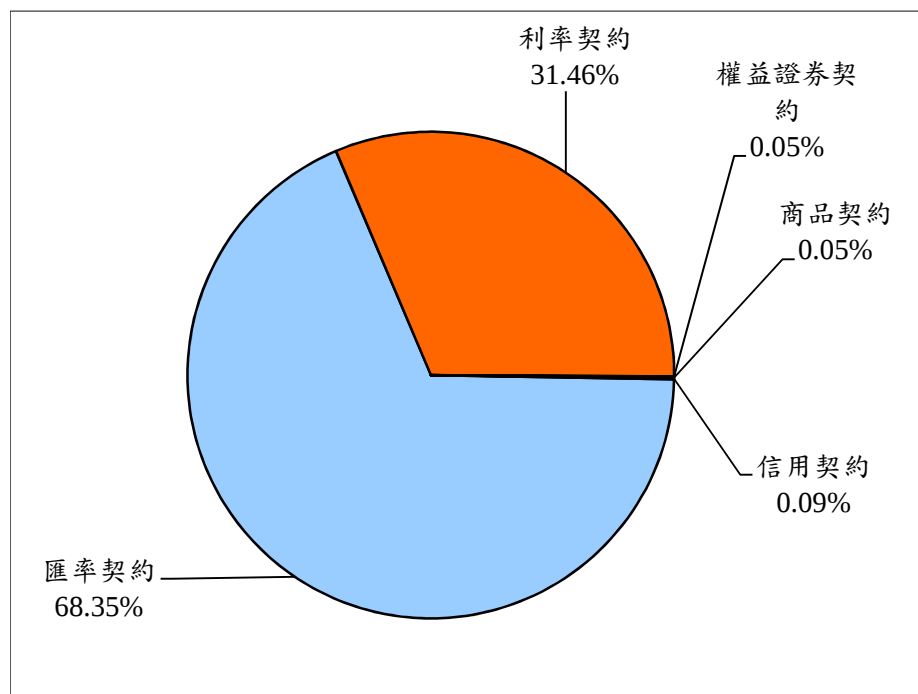
106年3月底



附圖2 銀行衍生性金融商品未結清契約內容分析

106年3月底

風險類別



銀行類別

