

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9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)	14,884,778	43,152,351	39,704	57,197	48,298	-	58,182,328	99.87
（一）遠期契約(Forwards)	99,378	27,303,941	-	219	-	-	27,403,538	47.04
（二）交換(Swaps)	14,267,435	2,263,626	26,212	18,355	48,298	-	16,623,926	28.53
（三）買入選擇權(Bought Options)	173,339	6,781,309	5,152	19,269	-	-	6,979,069	11.98
（四）賣出選擇權(Sold Options)	344,626	6,803,475	8,340	19,354	-	-	7,175,795	12.32
二、交易所(Exchange-traded Contracts)	51,580	8,839	15,737	853	-	-	77,009	0.13
（一）期貨-長部位(Futures-Long Positions)	3,534	1,769	71	415	-	-	5,789	0.01
（二）期貨-短部位(Futures-Short Positions)	48,046	7,070	988	349	-	-	56,453	0.10
（三）買入選擇權(Bought Options)	-	-	8,016	46	-	-	8,062	0.01
（四）賣出選擇權(Sold Options)	-	-	6,662	43	-	-	6,705	0.01
合 計	14,936,358	43,161,190	55,441	58,050	48,298	-	58,259,337	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	14,772,760	43,104,799	55,441	58,050	48,298	-	58,039,348	99.62
二、非交易目的	163,598	56,391	-	-	-	-	219,989	0.38
合 計	14,936,358	43,161,190	55,441	58,050	48,298	-	58,259,337	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；%

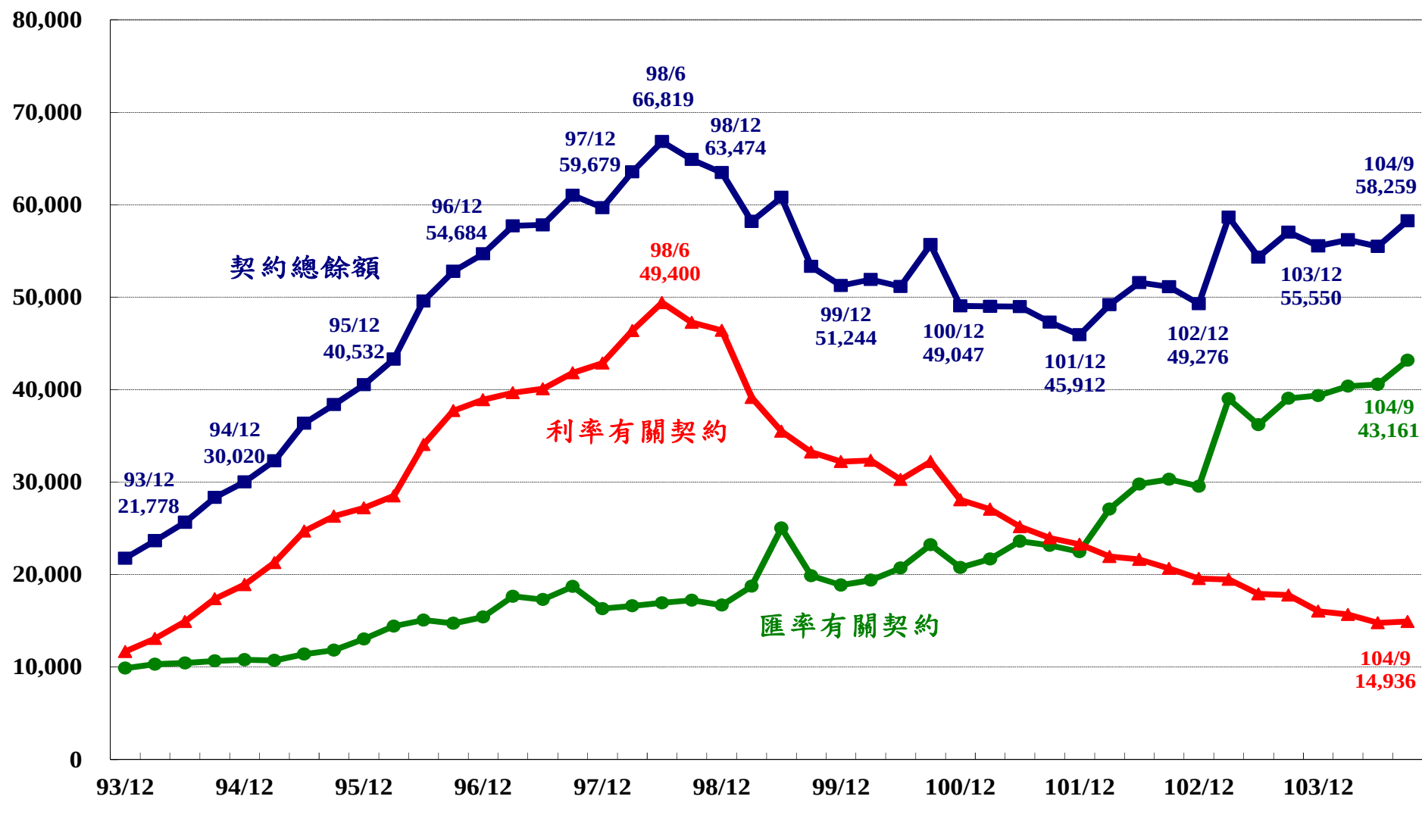
項 目	104年9月底		104年6月底		比較增減	
	金額	比重	金額	比重	金額	變動率
一、店頭市場(OTC)	58,182,328	99.87	55,401,379	99.85	2,780,949	5.02
（一）遠期契約(Forwards)	27,403,538	47.04	23,402,516	42.18	4,001,022	17.10
（二）交換(Swaps)	16,623,926	28.53	16,337,052	29.44	286,874	1.76
（三）買入選擇權(Bought Options)	6,979,069	11.98	7,744,935	13.96	-765,866	-9.89
（四）賣出選擇權(Sold Options)	7,175,795	12.32	7,916,876	14.27	-741,081	-9.36
二、交易所(Exchange-traded Contracts)	77,009	0.13	82,253	0.15	-5,244	-6.38
（一）期貨-長部位(Futures-Long Positions)	5,789	0.01	6,318	0.01	-529	-8.37
（二）期貨-短部位(Futures-Short Positions)	56,453	0.10	60,464	0.11	-4,011	-6.63
（三）買入選擇權(Bought Options)	8,062	0.01	6,671	0.01	1,391	20.85
（四）賣出選擇權(Sold Options)	6,705	0.01	8,800	0.02	-2,095	-23.81
合 計	58,259,337	100.00	55,483,632	100.00	2,775,705	5.00

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(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

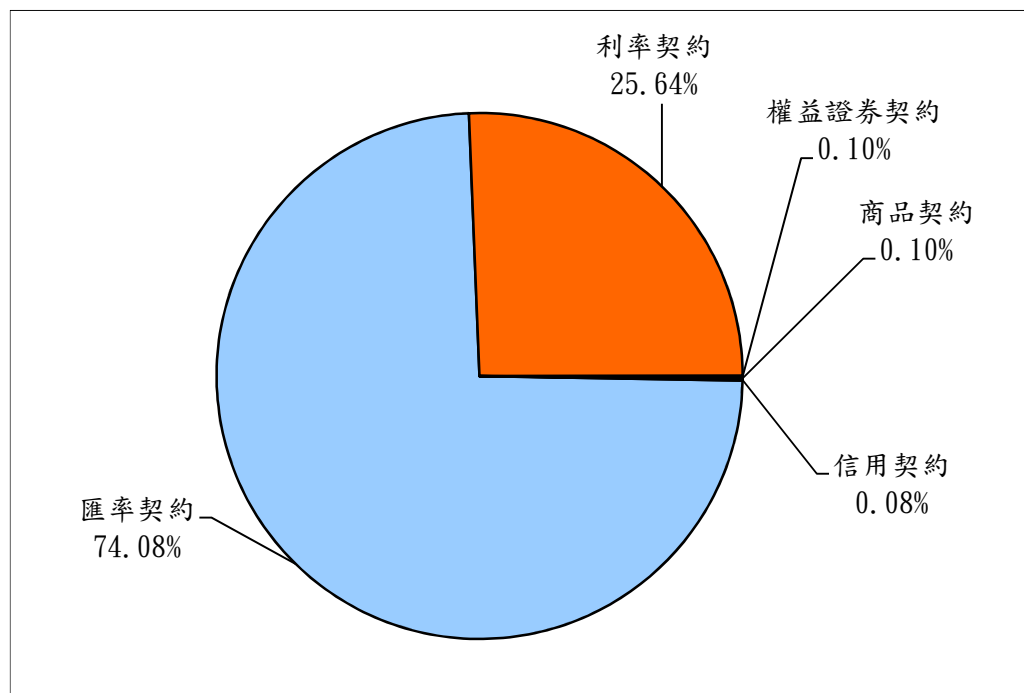
104年9月底



附圖2 銀行衍生性金融商品未結清契約內容分析

104年9月底

風險類別



銀行類別

