

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6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, 049, 534	38, 268, 554	26, 045	30, 085	58, 298	-	53, 432, 516	99. 77
(一)遠期契約(Forwards)	-	28, 425, 372	-	105	-	-	28, 425, 477	53. 08
(二)交換(Swaps)	14, 475, 797	2, 548, 404	14, 054	18, 578	58, 298	-	17, 115, 131	31. 96
(三)買入選擇權(Bought Options)	173, 937	3, 644, 874	3, 146	5, 662	-	-	3, 827, 619	7. 14
(四)賣出選擇權(Sold Options)	399, 800	3, 649, 904	8, 845	5, 740	-	-	4, 064, 289	7. 59
二、交易所(Exchange-traded Contracts)	99, 577	10, 982	11, 379	447	-	-	122, 385	0. 23
(一)期貨-長部位(Futures-Long Positions)	9, 946	5, 139	259	345	-	-	15, 689	0. 03
(二)期貨-短部位(Futures-Short Positions)	89, 631	3, 952	930	90	-	-	94, 603	0. 18
(三)買入選擇權(Bought Options)	-	951	4, 557	5	-	-	5, 513	0. 01
(四)賣出選擇權(Sold Options)	-	940	5, 633	7	-	-	6, 580	0. 01
合 計	15, 149, 111	38, 279, 536	37, 424	30, 532	58, 298	-	53, 554, 901	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, 023, 857	38, 228, 725	33, 904	30, 532	58, 298	-	53, 375, 316	99. 66
二、非交易目的	125, 254	50, 811	3, 520	-	-	-	179, 585	0. 34
合 計	15, 149, 111	38, 279, 536	37, 424	30, 532	58, 298	-	53, 554, 901	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；%

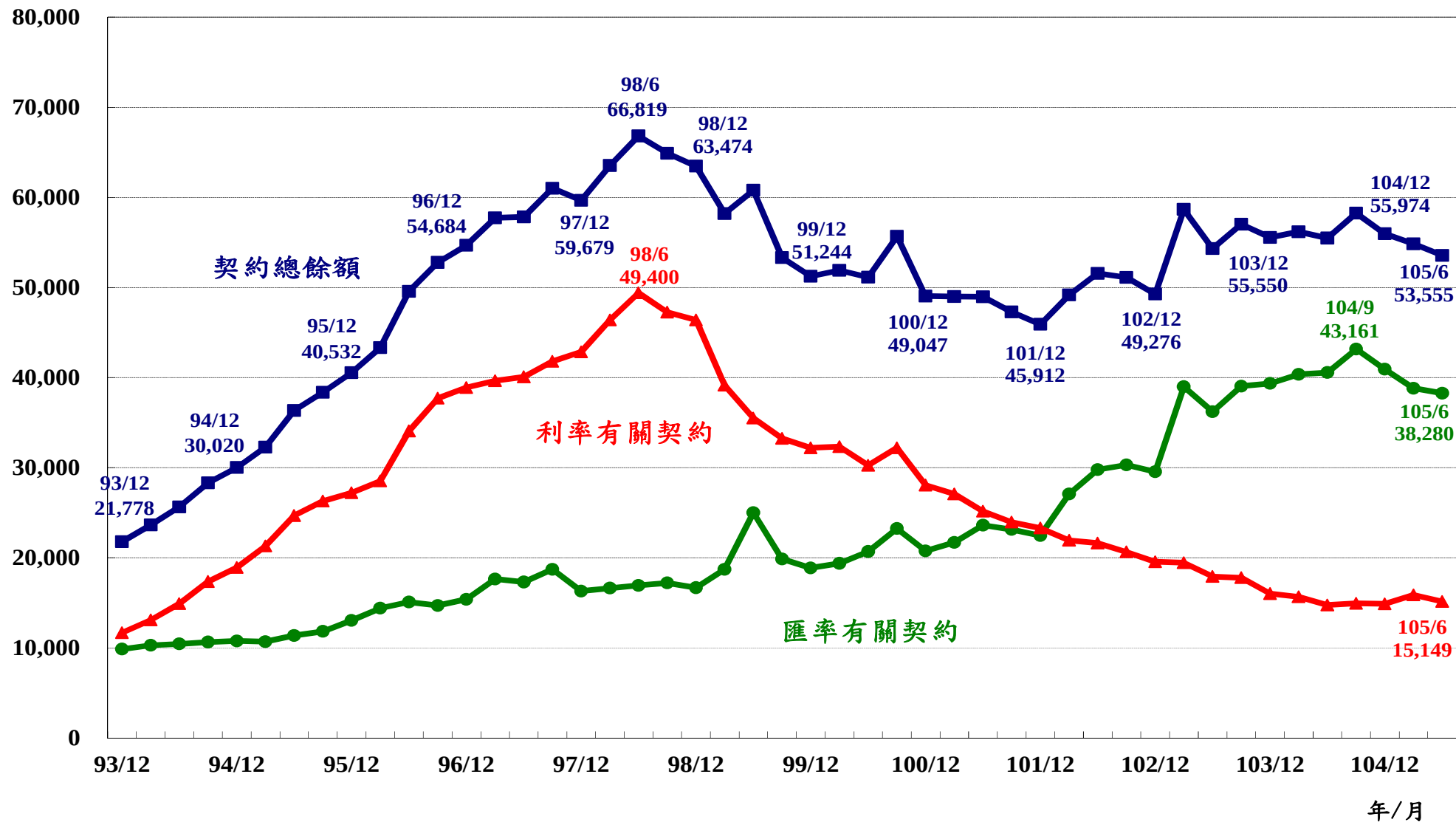
項 目	105年6月底		105年3月底		比較增減	
	金額	比重	金額	比重	金額	變動率
一、店頭市場(OTC)	53,432,516	99.77	54,752,913	99.84	-1,320,397	-2.41
（一）遠期契約(Forwards)	28,425,477	53.08	27,810,135	50.71	615,342	2.21
（二）交換(Swaps)	17,115,131	31.96	17,494,638	31.90	-379,507	-2.17
（三）買入選擇權(Bought Options)	3,827,619	7.14	4,640,845	8.46	-813,226	-17.52
（四）賣出選擇權(Sold Options)	4,064,289	7.59	4,807,295	8.77	-743,006	-15.46
二、交易所(Exchange-traded Contracts)	122,385	0.23	90,238	0.16	32,147	35.62
（一）期貨-長部位(Futures-Long Positions)	15,689	0.03	10,965	0.02	4,724	43.08
（二）期貨-短部位(Futures-Short Positions)	94,603	0.18	60,136	0.11	34,467	57.32
（三）買入選擇權(Bought Options)	5,513	0.01	6,875	0.01	-1,362	-19.81
（四）賣出選擇權(Sold Options)	6,580	0.01	12,262	0.02	-5,682	-46.34
合 計	53,554,901	100.00	54,843,151	100.00	-1,288,250	-2.35

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)。

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

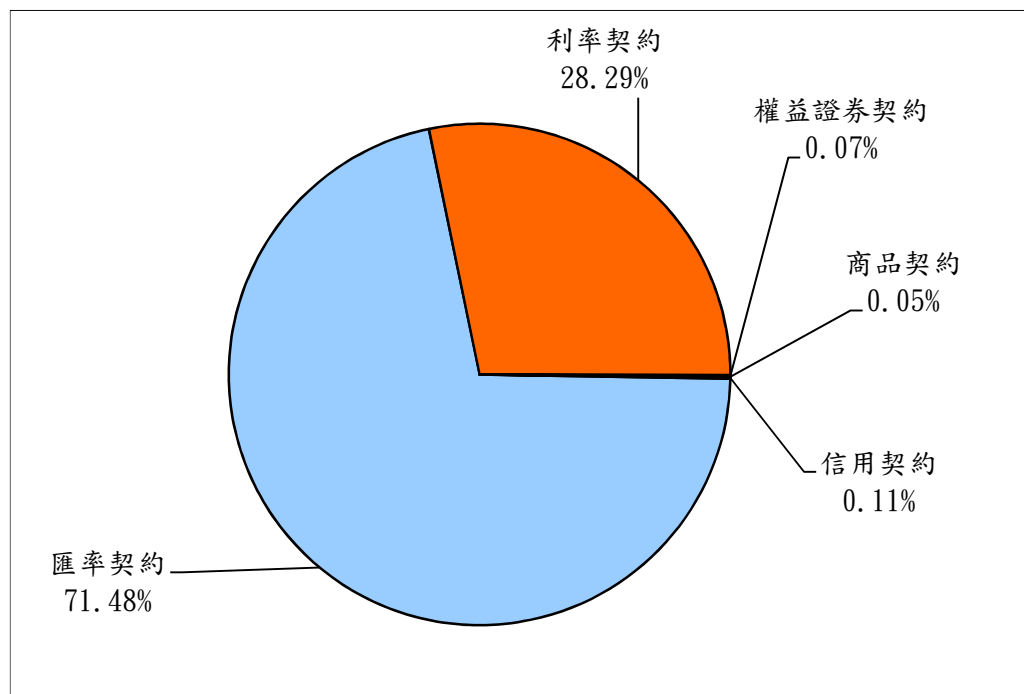
105年6月底



附圖2 銀行衍生性金融商品未結清契約內容分析

105年6月底

風險類別



銀行類別

