

## 附表1 銀行衍生性金融商品未結清契約名目本金餘額

108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
<b>一、店頭市場(OTC)</b>	22,075,988	37,859,980	14,262	5,259	50,020	-	60,005,509	99.60
(一)遠期契約(Forwards)	-	34,411,516	-	98	-	-	34,411,614	57.12
(二)交換(Swaps)	20,603,678	2,035,919	12,862	2,217	50,020	-	22,704,696	37.69
(三)買入選擇權(Bought Options)	423,094	715,313	610	1,478	-	-	1,140,495	1.89
(四)賣出選擇權(Sold Options)	1,049,216	697,232	790	1,466	-	-	1,748,704	2.90
<b>二、交易所(Exchange-traded Contracts)</b>	203,446	19,947	18,276	913	-	-	242,582	0.40
(一)期貨-長部位(Futures-Long Positions)	96,361	6,218	1,508	504	-	-	104,591	0.17
(二)期貨-短部位(Futures-Short Positions)	106,278	6,507	1,960	260	-	-	115,005	0.19
(三)買入選擇權(Bought Options)	807	3,698	5,950	80	-	-	10,535	0.02
(四)賣出選擇權(Sold Options)	-	3,524	8,858	69	-	-	12,451	0.02
<b>合 計</b>	<b>22,279,434</b>	<b>37,879,927</b>	<b>32,538</b>	<b>6,172</b>	<b>50,020</b>	<b>-</b>	<b>60,248,091</b>	<b>100.00</b>

### 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
<b>一、交易目的</b>	22,044,188	37,696,686	32,538	6,172	50,020	-	59,829,604	99.31
<b>二、非交易目的</b>	235,246	183,241	-	-	-	-	418,487	0.69
<b>合 計</b>	<b>22,279,434</b>	<b>37,879,927</b>	<b>32,538</b>	<b>6,172</b>	<b>50,020</b>	<b>-</b>	<b>60,248,091</b>	<b>100.00</b>

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；%

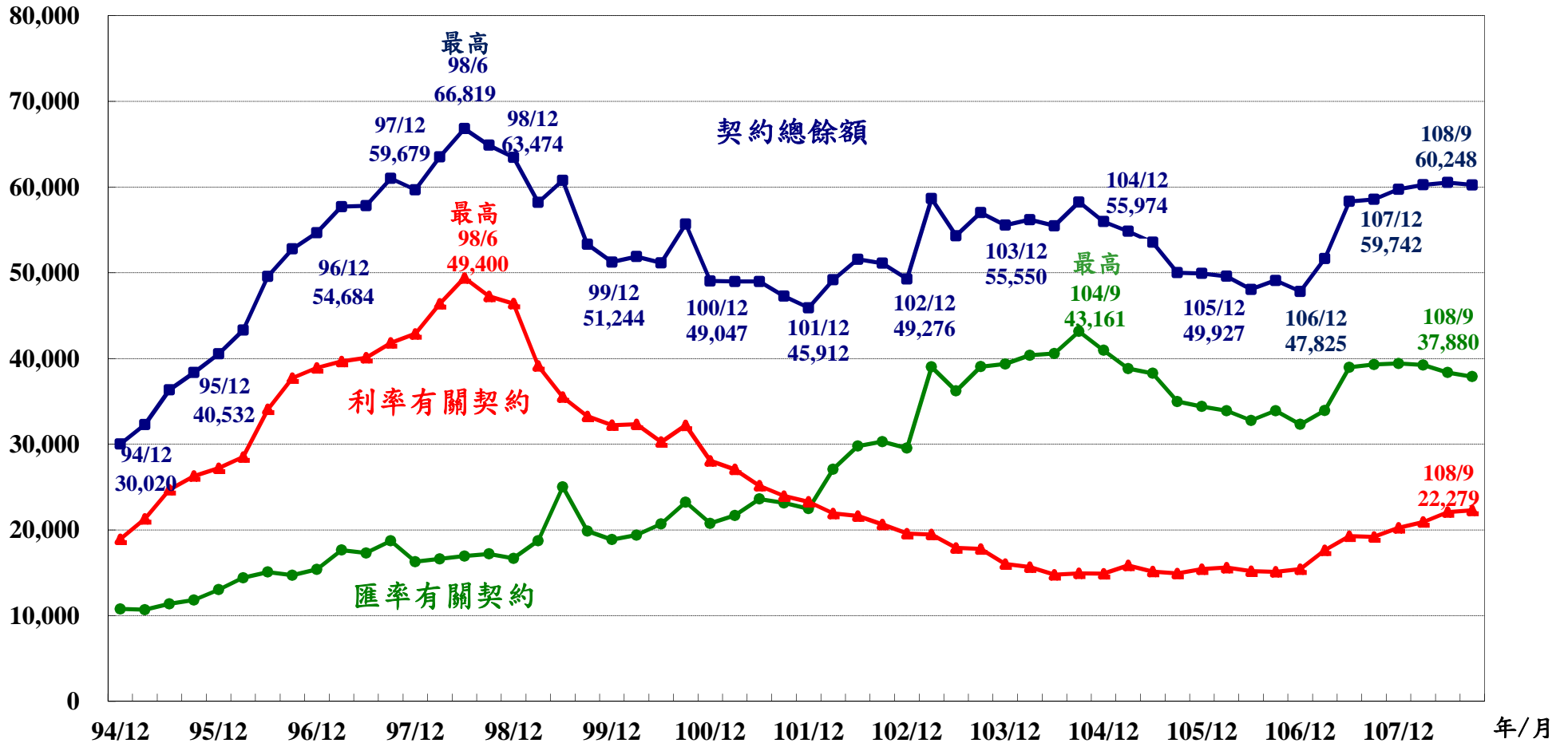
項 目	108年9月底		108年6月底		比較增減	
	金額	比重	金額	比重	金額	變動率
<b>一、店頭市場(OTC)</b>	60,005,509	99.60	60,357,419	99.70	-351,910	-0.58
(一)遠期契約(Forwards)	34,411,614	57.12	34,908,964	57.66	-497,350	-1.42
(二)交換(Swaps)	22,704,696	37.69	22,508,134	37.18	196,562	0.87
(三)買入選擇權(Bought Options)	1,140,495	1.89	1,124,294	1.86	16,201	1.44
(四)賣出選擇權(Sold Options)	1,748,704	2.90	1,816,027	3.00	-67,323	-3.71
<b>二、交易所(Exchange-traded Contracts)</b>	242,582	0.40	181,845	0.30	60,737	33.40
(一)期貨-長部位(Futures-Long Positions)	104,591	0.17	79,750	0.13	24,841	31.15
(二)期貨-短部位(Futures-Short Positions)	115,005	0.19	87,112	0.14	27,893	32.02
(三)買入選擇權(Bought Options)	10,535	0.02	5,365	0.01	5,170	96.37
(四)賣出選擇權(Sold Options)	12,451	0.02	9,618	0.02	2,833	29.46
<b>合 計</b>	<b>60,248,091</b>	<b>100.00</b>	<b>60,539,264</b>	<b>100.00</b>	<b>-291,173</b>	<b>-0.48</b>

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)。

# 附圖1 銀行衍生性金融商品未結清契約統計

108年9月底

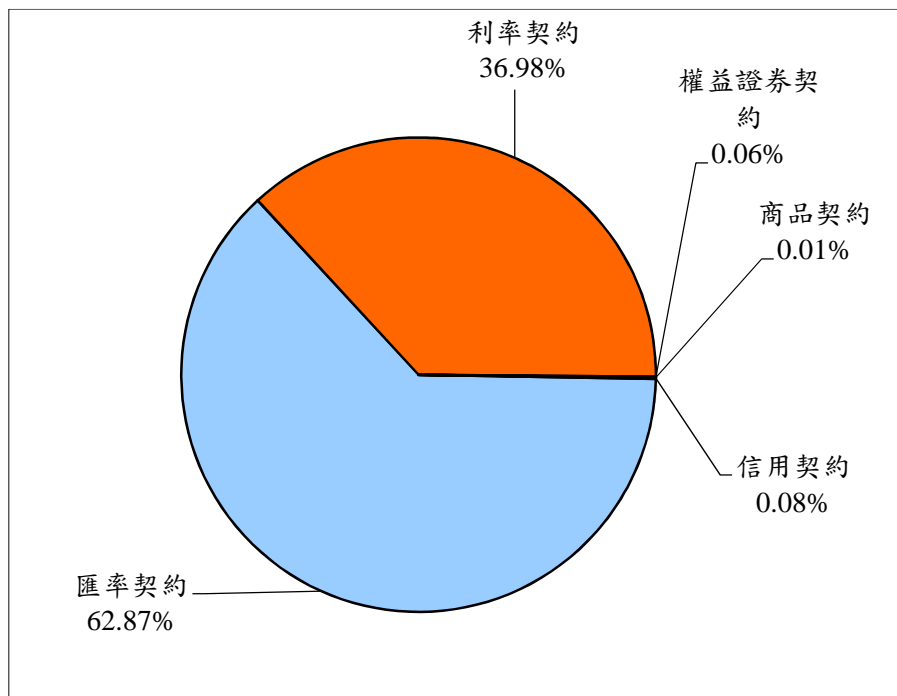
新臺幣10億元



## 附圖2 銀行衍生性金融商品未結清契約內容分析

108年9月底

### 風險類別



### 銀行類別

