

附表1 銀行衍生性金融商品未結清契約名目本金餘額

109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)	21,915,731	35,763,923	8,955	13,418	43,463	-	57,745,490	99.62
(一)遠期契約(Forwards)	2,796	32,636,895	-	564	-	-	32,640,255	56.31
(二)交換(Swaps)	20,718,334	1,524,958	8,051	4,845	43,463	-	22,299,651	38.47
(三)買入選擇權(Bought Options)	437,352	803,517	326	4,044	-	-	1,245,239	2.15
(四)賣出選擇權(Sold Options)	757,249	798,553	578	3,965	-	-	1,560,345	2.69
二、交易所(Exchange-traded Contracts)	194,893	14,414	9,813	370	-	-	219,490	0.38
(一)期貨-長部位(Futures-Long Positions)	9,259	9,237	832	206	-	-	19,534	0.03
(二)期貨-短部位(Futures-Short Positions)	185,488	3,476	1,231	33	-	-	190,228	0.33
(三)買入選擇權(Bought Options)	146	938	2,967	67	-	-	4,118	0.01
(四)賣出選擇權(Sold Options)	-	763	4,783	64	-	-	5,610	0.01
合 計	22,110,624	35,778,337	18,768	13,788	43,463	-	57,964,980	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	21,808,680	35,643,787	18,768	13,788	43,463	-	57,528,486	99.25
二、非交易目的	301,944	134,550	-	-	-	-	436,494	0.75
合 計	22,110,624	35,778,337	18,768	13,788	43,463	-	57,964,980	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	109年9月底		109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)	57,745,490	99.62	58,996,197	99.65	-1,250,707	-2.12
(一)遠期契約(Forwards)	32,640,255	56.31	33,528,396	56.63	-888,141	-2.65
(二)交換(Swaps)	22,299,651	38.47	22,845,849	38.59	-546,198	-2.39
(三)買入選擇權(Bought Options)	1,245,239	2.15	1,155,319	1.95	89,920	7.78
(四)賣出選擇權(Sold Options)	1,560,345	2.69	1,466,633	2.48	93,712	6.39
二、交易所(Exchange-traded Contracts)	219,490	0.38	209,164	0.35	10,326	4.94
(一)期貨-長部位(Futures-Long Positions)	19,534	0.03	25,369	0.04	-5,835	-23.00
(二)期貨-短部位(Futures-Short Positions)	190,228	0.33	173,554	0.29	16,674	9.61
(三)買入選擇權(Bought Options)	4,118	0.01	5,496	0.01	-1,378	-25.07
(四)賣出選擇權(Sold Options)	5,610	0.01	4,745	0.01	865	18.23
合 計	57,964,980	100.00	59,205,361	100.00	-1,240,381	-2.10

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)。