附表1 銀行衍生性金融商品未結清契約名目本金餘額

110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)	21,247,375	34,524,120	11,960	8,802	31,769	-	55,824,026	99.61
(一)遠期契約(Forwards)	11,202	31,885,286	-	1,016	-	-	31,897,504	56.92
(二)交換(Swaps)	20,066,275	1,323,051	10,031	3,268	31,769	-	21,434,394	38.25
(三)買入選擇權(Bought Options)	457,295	657,559	797	2,259	-	-	1,117,910	1.99
(四)賣出選擇權(Sold Options)	712,603	658,224	1,132	2,259	-	-	1,374,218	2.45
二、交易所(Exchange-traded Contracts)	194,257	12,865	8,972	941	-	-	217,035	0.39
(一)期貨-長部位(Futures-Long Positions)	16,644	9,404	3,077	364	-	-	29,489	0.05
(二)期貨-短部位(Futures-Short Positions)	177,613	2,748	1,585	521	-	-	182,467	0.33
(三)買入選擇權(Bought Options)	-	355	1,494	28	-	-	1,877	0.00
(四)賣出選擇權(Sold Options)	-	358	2,816	28	-	-	3,202	0.01
合 計	21,441,632	34,536,985	20,932	9,743	31,769	-	56,041,061	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	21,132,266	34,409,755	20,932	9,743	31,769	-	55,604,465	99.22
二、非交易目的	309,366	127,230	-	-	-	-	436,596	0.78
合 計	21,441,632	34,536,985	20,932	9,743	31,769	-	56,041,061	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	110年3月底		109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)	55,824,026	99.61	54,267,963	99.71	1,556,063	2.87
(一)遠期契約(Forwards)	31,897,504	56.92	30,445,559	55.94	1,451,945	4.77
(二)交換(Swaps)	21,434,394	38.25	21,559,436	39.61	-125,042	-0.58
(三)買入選擇權(Bought Options)	1,117,910	1.99	978,197	1.80	139,713	14.28
(四)賣出選擇權(Sold Options)	1,374,218	2.45	1,284,771	2.36	89,447	6.96
二、交易所(Exchange-traded Contracts)	217,035	0.39	159,152	0.29	57,883	36.37
(一)期貨-長部位(Futures-Long Positions)	29,489	0.05	17,424	0.03	12,065	69.24
(二)期貨-短部位(Futures-Short Positions)	182,467	0.33	137,342	0.25	45,125	32.86
(三)買入選擇權(Bought Options)	1,877	0.00	2,854	0.01	-977	-34.23
(四)賣出選擇權(Sold Options)	3,202	0.01	1,532	0.00	1,670	109.01
合 計	56,041,061	100.00	54,427,115	100.00	1,613,946	2.97

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)。