

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12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)	21,114,396	33,103,498	9,514	6,085	34,470	-	54,267,963	99.71
(一)遠期契約(Forwards)	-	30,444,766	-	793	-	-	30,445,559	55.94
(二)交換(Swaps)	19,984,035	1,529,595	8,536	2,800	34,470	-	21,559,436	39.61
(三)買入選擇權(Bought Options)	412,394	564,117	427	1,259	-	-	978,197	1.80
(四)賣出選擇權(Sold Options)	717,967	565,020	551	1,233	-	-	1,284,771	2.36
二、交易所(Exchange-traded Contracts)	139,084	13,569	6,183	316	-	-	159,152	0.29
(一)期貨-長部位(Futures-Long Positions)	8,314	7,853	1,103	154	-	-	17,424	0.03
(二)期貨-短部位(Futures-Short Positions)	130,770	4,635	1,775	162	-	-	137,342	0.25
(三)買入選擇權(Bought Options)	-	564	2,290	-	-	-	2,854	0.01
(四)賣出選擇權(Sold Options)	-	517	1,015	-	-	-	1,532	0.00
合 計	21,253,480	33,117,067	15,697	6,401	34,470	-	54,427,115	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	20,946,514	32,978,590	15,697	6,401	34,470	-	53,981,672	99.18
二、非交易目的	306,966	138,477	-	-	-	-	445,443	0.82
合 計	21,253,480	33,117,067	15,697	6,401	34,470	-	54,427,115	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12月底		109年9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)	54,267,963	99.71	r 57,743,843	99.62	-3,475,880	-6.02
(一)遠期契約(Forwards)	30,445,559	55.94	r 32,638,608	56.31	-2,193,049	-6.72
(二)交換(Swaps)	21,559,436	39.61	22,299,651	38.47	-740,215	-3.32
(三)買入選擇權(Bought Options)	978,197	1.80	1,245,239	2.15	-267,042	-21.45
(四)賣出選擇權(Sold Options)	1,284,771	2.36	1,560,345	2.69	-275,574	-17.66
二、交易所(Exchange-traded Contracts)	159,152	0.29	219,490	0.38	-60,338	-27.49
(一)期貨-長部位(Futures-Long Positions)	17,424	0.03	19,534	0.03	-2,110	-10.80
(二)期貨-短部位(Futures-Short Positions)	137,342	0.25	190,228	0.33	-52,886	-27.80
(三)買入選擇權(Bought Options)	2,854	0.01	4,118	0.01	-1,264	-30.69
(四)賣出選擇權(Sold Options)	1,532	0.00	5,610	0.01	-4,078	-72.69
合 計	54,427,115	100.00	r 57,963,333	100.00	-3,536,218	-6.10

註：1. 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)。

2. r為修正數。