

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)	21,006,591	33,864,615	12,910	7,062	27,721	-	54,918,899	99.58
(一)遠期契約(Forwards)	400	31,299,160	-	930	-	-	31,300,490	56.75
(二)交換(Swaps)	19,692,659	1,250,817	10,740	2,869	27,721	-	20,984,806	38.05
(三)買入選擇權(Bought Options)	536,862	660,223	984	1,638	-	-	1,199,707	2.18
(四)賣出選擇權(Sold Options)	776,670	654,415	1,186	1,625	-	-	1,433,896	2.60
二、交易所(Exchange-traded Contracts)	215,224	12,276	4,749	288	-	-	232,537	0.42
(一)期貨-長部位(Futures-Long Positions)	13,570	9,754	2,492	223	-	-	26,039	0.05
(二)期貨-短部位(Futures-Short Positions)	201,654	2,365	663	65	-	-	204,747	0.37
(三)買入選擇權(Bought Options)	-	77	844	-	-	-	921	0.00
(四)賣出選擇權(Sold Options)	-	80	750	-	-	-	830	0.00
合 計	21,221,815	33,876,891	17,659	7,350	27,721	-	55,151,436	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	20,908,737	33,752,438	17,659	7,350	27,721	-	54,713,905	99.21
二、非交易目的	313,078	124,453	-	-	-	-	437,531	0.79
合 計	21,221,815	33,876,891	17,659	7,350	27,721	-	55,151,436	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6月底		110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)	54,918,899	99.58	55,824,026	99.61	-905,127	-1.62
(一)遠期契約(Forwards)	31,300,490	56.75	31,897,504	56.92	-597,014	-1.87
(二)交換(Swaps)	20,984,806	38.05	21,434,394	38.25	-449,588	-2.10
(三)買入選擇權(Bought Options)	1,199,707	2.18	1,117,910	1.99	81,797	7.32
(四)賣出選擇權(Sold Options)	1,433,896	2.60	1,374,218	2.45	59,678	4.34
二、交易所(Exchange-traded Contracts)	232,537	0.42	217,035	0.39	15,502	7.14
(一)期貨-長部位(Futures-Long Positions)	26,039	0.05	29,489	0.05	-3,450	-11.70
(二)期貨-短部位(Futures-Short Positions)	204,747	0.37	182,467	0.33	22,280	12.21
(三)買入選擇權(Bought Options)	921	0.00	1,877	0.00	-956	-50.93
(四)賣出選擇權(Sold Options)	830	0.00	3,202	0.01	-2,372	-74.08
合 計	55,151,436	100.00	56,041,061	100.00	-889,625	-1.59

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)。