

# 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>	21,649,058	35,278,651	14,393	5,885	30,032	-	56,978,019	99.51
(一)遠期契約(Forwards)	150	32,453,713	-	1,159	-	-	32,455,022	56.68
(二)交換(Swaps)	20,111,742	1,388,151	11,420	1,761	30,032	-	21,543,106	37.63
(三)買入選擇權(Bought Options)	685,457	721,014	1,392	1,486	-	-	1,409,349	2.46
(四)賣出選擇權(Sold Options)	851,709	715,773	1,581	1,479	-	-	1,570,542	2.74
<b>二、交易所(Exchange-traded Contracts)</b>	263,705	6,584	7,353	387	-	-	278,029	0.49
(一)期貨-長部位(Futures-Long Positions)	25,648	5,432	2,731	179	-	-	33,990	0.06
(二)期貨-短部位(Futures-Short Positions)	238,057	1,152	804	208	-	-	240,221	0.42
(三)買入選擇權(Bought Options)	-	-	1,667	-	-	-	1,667	0.00
(四)賣出選擇權(Sold Options)	-	-	2,151	-	-	-	2,151	0.01
<b>合 計</b>	21,912,763	35,285,235	21,746	6,272	30,032	-	57,256,048	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
<b>一、交易目的</b>	21,579,116	35,133,120	21,746	6,272	30,032	-	56,770,286	99.15
<b>二、非交易目的</b>	333,647	152,115	-	-	-	-	485,762	0.85
<b>合 計</b>	21,912,763	35,285,235	21,746	6,272	30,032	-	57,256,048	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9月底		110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>	<b>56,978,019</b>	<b>99.51</b>	<b>55,337,230</b>	<b>99.58</b>	<b>1,640,789</b>	<b>2.97</b>
(一)遠期契約(Forwards)	32,455,022	56.68	31,300,490	56.33	1,154,532	3.69
(二)交換(Swaps)	21,543,106	37.63	20,996,806	37.78	546,300	2.60
(三)買入選擇權(Bought Options)	1,409,349	2.46	1,434,808	2.58	-25,459	-1.77
(四)賣出選擇權(Sold Options)	1,570,542	2.74	1,605,126	2.89	-34,584	-2.15
<b>二、交易所(Exchange-traded Contracts)</b>	<b>278,029</b>	<b>0.49</b>	<b>232,537</b>	<b>0.42</b>	<b>45,492</b>	<b>19.56</b>
(一)期貨-長部位(Futures-Long Positions)	33,990	0.06	26,039	0.05	7,951	30.53
(二)期貨-短部位(Futures-Short Positions)	240,221	0.42	204,747	0.37	35,474	17.33
(三)買入選擇權(Bought Options)	1,667	0.00	921	0.00	746	81.00
(四)賣出選擇權(Sold Options)	2,151	0.01	830	0.00	1,321	159.16
<b>合 計</b>	<b>57,256,048</b>	<b>100.00</b>	<b>55,569,767</b>	<b>100.00</b>	<b>1,686,281</b>	<b>3.03</b>

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。