

# 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
<b>一、店頭市場(OTC)</b>	<b>21,929,691</b>	<b>36,299,932</b>	<b>14,942</b>	<b>8,369</b>	<b>32,192</b>	-	<b>58,285,126</b>	<b>99.53</b>
(一)遠期契約(Forwards)	100	33,688,387	-	1,325	-	-	33,689,812	57.53
(二)交換(Swaps)	20,489,988	1,457,786	11,232	2,563	32,192	-	21,993,761	37.56
(三)買入選擇權(Bought Options)	664,574	581,340	1,659	2,295	-	-	1,249,868	2.13
(四)賣出選擇權(Sold Options)	775,029	572,419	2,051	2,186	-	-	1,351,685	2.31
<b>二、交易所(Exchange-traded Contracts)</b>	<b>266,254</b>	<b>2,735</b>	<b>7,299</b>	<b>116</b>	-	-	<b>276,404</b>	<b>0.47</b>
(一)期貨-長部位(Futures-Long Positions)	13,579	2,145	3,668	39	-	-	19,431	0.03
(二)期貨-短部位(Futures-Short Positions)	252,675	590	837	77	-	-	254,179	0.44
(三)買入選擇權(Bought Options)	-	-	1,493	-	-	-	1,493	0.00
(四)賣出選擇權(Sold Options)	-	-	1,301	-	-	-	1,301	0.00
<b>合 計</b>	<b>22,195,945</b>	<b>36,302,667</b>	<b>22,241</b>	<b>8,485</b>	<b>32,192</b>	-	<b>58,561,530</b>	<b>100.00</b>

## 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>	<b>21,855,301</b>	<b>36,091,020</b>	<b>22,241</b>	<b>8,485</b>	<b>32,192</b>	-	<b>58,009,239</b>	<b>99.06</b>
<b>二、非交易目的</b>	<b>340,644</b>	<b>211,647</b>	-	-	-	-	<b>552,291</b>	<b>0.94</b>
<b>合 計</b>	<b>22,195,945</b>	<b>36,302,667</b>	<b>22,241</b>	<b>8,485</b>	<b>32,192</b>	-	<b>58,561,530</b>	<b>100.00</b>

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12月底		110年9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>58,285,126</b>	<b>99.53</b>	<b>56,995,271</b>	<b>99.51</b>	<b>1,289,855</b>	<b>2.26</b>
(一)遠期契約(Forwards)	33,689,812	57.53	32,455,022	56.67	1,234,790	3.80
(二)交換(Swaps)	21,993,761	37.56	21,543,106	37.61	450,655	2.09
(三)買入選擇權(Bought Options)	1,249,868	2.13	1,425,725	2.49	-175,857	-12.33
(四)賣出選擇權(Sold Options)	1,351,685	2.31	1,571,418	2.74	-219,733	-13.98
<b>二、交易所(Exchange-traded Contracts)</b>	<b>276,404</b>	<b>0.47</b>	<b>278,029</b>	<b>0.49</b>	<b>-1,625</b>	<b>-0.58</b>
(一)期貨-長部位(Futures-Long Positions)	19,431	0.03	33,990	0.06	-14,559	-42.83
(二)期貨-短部位(Futures-Short Positions)	254,179	0.44	240,221	0.42	13,958	5.81
(三)買入選擇權(Bought Options)	1,493	0.00	1,667	0.00	-174	-10.44
(四)賣出選擇權(Sold Options)	1,301	0.00	2,151	0.01	-850	-39.52
<b>合 計</b>	<b>58,561,530</b>	<b>100.00</b>	<b>57,273,300</b>	<b>100.00</b>	<b>1,288,230</b>	<b>2.25</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。