

附表1 銀行衍生性金融商品未結清契約名目本金餘額

111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)	24,181,063	41,070,418	17,222	9,541	37,695	-	65,315,939	99.48
(一)遠期契約(Forwards)	400	38,007,744	-	2,350	-	-	38,010,494	57.89
(二)交換(Swaps)	22,482,269	1,493,731	13,263	2,261	37,695	-	24,029,219	36.60
(三)買入選擇權(Bought Options)	795,547	786,210	1,620	2,465	-	-	1,585,842	2.42
(四)賣出選擇權(Sold Options)	902,847	782,733	2,339	2,465	-	-	1,690,384	2.57
二、交易所(Exchange-traded Contracts)	328,726	668	14,764	172	-	-	344,330	0.52
(一)期貨-長部位(Futures-Long Positions)	34,479	364	3,914	3	-	-	38,760	0.05
(二)期貨-短部位(Futures-Short Positions)	294,247	304	1,511	152	-	-	296,214	0.45
(三)買入選擇權(Bought Options)	-	-	4,074	10	-	-	4,084	0.01
(四)賣出選擇權(Sold Options)	-	-	5,265	7	-	-	5,272	0.01
合 計	24,509,789	41,071,086	31,986	9,713	37,695	-	65,660,269	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	24,149,026	40,895,698	31,986	9,713	37,695	-	65,124,118	99.18
二、非交易目的	360,763	175,388	-	-	-	-	536,151	0.82
合 計	24,509,789	41,071,086	31,986	9,713	37,695	-	65,660,269	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	111年3月底		110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)	65,315,939	99.48	58,285,126	99.53	7,030,813	12.06
(一)遠期契約(Forwards)	38,010,494	57.89	33,689,812	57.53	4,320,682	12.82
(二)交換(Swaps)	24,029,219	36.60	21,993,761	37.56	2,035,458	9.25
(三)買入選擇權(Bought Options)	1,585,842	2.42	1,249,868	2.13	335,974	26.88
(四)賣出選擇權(Sold Options)	1,690,384	2.57	1,351,685	2.31	338,699	25.06
二、交易所(Exchange-traded Contracts)	344,330	0.52	276,404	0.47	67,926	24.57
(一)期貨-長部位(Futures-Long Positions)	38,760	0.05	19,431	0.03	19,329	99.48
(二)期貨-短部位(Futures-Short Positions)	296,214	0.45	254,179	0.44	42,035	16.54
(三)買入選擇權(Bought Options)	4,084	0.01	1,493	0.00	2,591	173.54
(四)賣出選擇權(Sold Options)	5,272	0.01	1,301	0.00	3,971	305.23
合 計	65,660,269	100.00	58,561,530	100.00	7,098,739	12.12

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)。