

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)	26,106,022	42,792,782	16,576	13,246	39,575	-	68,968,201	99.60
(一)遠期契約(Forwards)	100	39,546,787	-	921	-	-	39,547,808	57.11
(二)交換(Swaps)	24,323,228	1,573,274	12,970	4,749	39,575	-	25,953,796	37.48
(三)買入選擇權(Bought Options)	862,942	834,367	1,318	3,788	-	-	1,702,415	2.46
(四)賣出選擇權(Sold Options)	919,752	838,354	2,288	3,788	-	-	1,764,182	2.55
二、交易所(Exchange-traded Contracts)	268,170	109	7,669	628	-	-	276,576	0.40
(一)期貨-長部位(Futures-Long Positions)	60,132	55	3,367	353	-	-	63,907	0.09
(二)期貨-短部位(Futures-Short Positions)	208,038	54	2,694	275	-	-	211,061	0.31
(三)買入選擇權(Bought Options)	-	-	633	-	-	-	633	0.00
(四)賣出選擇權(Sold Options)	-	-	975	-	-	-	975	0.00
合 計	26,374,192	42,792,891	24,245	13,874	39,575	-	69,244,777	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	26,008,905	42,586,408	24,245	13,874	39,575	-	68,673,007	99.17
二、非交易目的	365,287	206,483	-	-	-	-	571,770	0.83
合 計	26,374,192	42,792,891	24,245	13,874	39,575	-	69,244,777	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6月底		111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)	68,968,201	99.60	65,315,939	99.48	3,652,262	5.59
(一)遠期契約(Forwards)	39,547,808	57.11	38,010,494	57.89	1,537,314	4.04
(二)交換(Swaps)	25,953,796	37.48	24,029,219	36.60	1,924,577	8.01
(三)買入選擇權(Bought Options)	1,702,415	2.46	1,585,842	2.42	116,573	7.35
(四)賣出選擇權(Sold Options)	1,764,182	2.55	1,690,384	2.57	73,798	4.37
二、交易所(Exchange-traded Contracts)	276,576	0.40	344,330	0.52	-67,754	-19.68
(一)期貨-長部位(Futures-Long Positions)	63,907	0.09	38,760	0.05	25,147	64.88
(二)期貨-短部位(Futures-Short Positions)	211,061	0.31	296,214	0.45	-85,153	-28.75
(三)買入選擇權(Bought Options)	633	0.00	4,084	0.01	-3,451	-84.50
(四)賣出選擇權(Sold Options)	975	0.00	5,272	0.01	-4,297	-81.51
合 計	69,244,777	100.00	65,660,269	100.00	3,584,508	5.46

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)。