

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
一、店頭市場(OTC)	28,293,767	47,885,850	15,675	18,421	44,882	-	76,258,595	99.76
(一)遠期契約(Forwards)	-	44,515,763	-	1,090	-	-	44,516,853	58.24
(二)交換(Swaps)	26,229,122	1,540,033	12,420	5,541	44,882	-	27,831,998	36.41
(三)買入選擇權(Bought Options)	987,023	909,548	1,050	5,895	-	-	1,903,516	2.49
(四)賣出選擇權(Sold Options)	1,077,622	920,506	2,205	5,895	-	-	2,006,228	2.62
二、交易所(Exchange-traded Contracts)	166,154	415	13,888	84	-	-	180,541	0.24
(一)期貨-長部位(Futures-Long Positions)	16,729	191	1,440	26	-	-	18,386	0.02
(二)期貨-短部位(Futures-Short Positions)	149,425	224	6,017	58	-	-	155,724	0.20
(三)買入選擇權(Bought Options)	-	-	3,194	-	-	-	3,194	0.01
(四)賣出選擇權(Sold Options)	-	-	3,237	-	-	-	3,237	0.01
合 計	28,459,921	47,886,265	29,563	18,505	44,882	-	76,439,136	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	28,041,553	47,683,802	29,563	18,505	44,882	-	75,818,305	99.19
二、非交易目的	418,368	202,463	-	-	-	-	620,831	0.81
合 計	28,459,921	47,886,265	29,563	18,505	44,882	-	76,439,136	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9月底		111年6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)	76,258,595	99.76	68,968,201	99.60	7,290,394	10.57
(一)遠期契約(Forwards)	44,516,853	58.24	39,547,808	57.11	4,969,045	12.56
(二)交換(Swaps)	27,831,998	36.41	25,953,796	37.48	1,878,202	7.24
(三)買入選擇權(Bought Options)	1,903,516	2.49	1,702,415	2.46	201,101	11.81
(四)賣出選擇權(Sold Options)	2,006,228	2.62	1,764,182	2.55	242,046	13.72
二、交易所(Exchange-traded Contracts)	180,541	0.24	276,576	0.40	-96,035	-34.72
(一)期貨-長部位(Futures-Long Positions)	18,386	0.02	63,907	0.09	-45,521	-71.23
(二)期貨-短部位(Futures-Short Positions)	155,724	0.20	211,061	0.31	-55,337	-26.22
(三)買入選擇權(Bought Options)	3,194	0.01	633	0.00	2,561	404.58
(四)賣出選擇權(Sold Options)	3,237	0.01	975	0.00	2,262	232.00
合 計	76,439,136	100.00	69,244,777	100.00	7,194,359	10.39

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)。