

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
一、店頭市場(OTC)	28,653,392	41,454,702	22,406	20,174	40,928	-	70,191,602	99.77
(一)遠期契約(Forwards)	-	38,906,126	-	586	-	-	38,906,712	55.30
(二)交換(Swaps)	26,633,736	1,340,193	15,080	10,542	40,928	-	28,040,479	39.86
(三)買入選擇權(Bought Options)	957,365	603,298	3,047	4,523	-	-	1,568,233	2.23
(四)賣出選擇權(Sold Options)	1,062,291	605,085	4,279	4,523	-	-	1,676,178	2.38
二、交易所(Exchange-traded Contracts)	161,127	368	1,692	66	-	-	163,253	0.23
(一)期貨-長部位(Futures-Long Positions)	48,743	184	178	20	-	-	49,125	0.07
(二)期貨-短部位(Futures-Short Positions)	112,384	184	416	46	-	-	113,030	0.16
(三)買入選擇權(Bought Options)	-	-	257	-	-	-	257	0.00
(四)賣出選擇權(Sold Options)	-	-	841	-	-	-	841	0.00
合 計	28,814,519	41,455,070	24,098	20,240	40,928	-	70,354,855	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	28,405,542	41,162,821	24,098	20,240	40,928	-	69,653,629	99.00
二、非交易目的	408,977	292,249	-	-	-	-	701,226	1.00
合 計	28,814,519	41,455,070	24,098	20,240	40,928	-	70,354,855	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12月底		111年9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)	70,191,602	99.77	76,258,595	99.76	-6,066,993	-7.96
(一)遠期契約(Forwards)	38,906,712	55.30	44,516,853	58.24	-5,610,141	-12.60
(二)交換(Swaps)	28,040,479	39.86	27,831,998	36.41	208,481	0.75
(三)買入選擇權(Bought Options)	1,568,233	2.23	1,903,516	2.49	-335,283	-17.61
(四)賣出選擇權(Sold Options)	1,676,178	2.38	2,006,228	2.62	-330,050	-16.45
二、交易所(Exchange-traded Contracts)	163,253	0.23	180,541	0.24	-17,288	-9.58
(一)期貨-長部位(Futures-Long Positions)	49,125	0.07	18,386	0.02	30,739	167.19
(二)期貨-短部位(Futures-Short Positions)	113,030	0.16	155,724	0.20	-42,694	-27.42
(三)買入選擇權(Bought Options)	257	0.00	3,194	0.01	-2,937	-91.95
(四)賣出選擇權(Sold Options)	841	0.00	3,237	0.01	-2,396	-74.02
合 計	70,354,855	100.00	76,439,136	100.00	-6,084,281	-7.96

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)。