附表1 銀行衍生性金融商品未結清契約名目本金餘額

112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)	28,908,471	43,186,062	30,271	20,200	37,803	-	72,182,807	99.84
(一)遠期契約(Forwards)	200	40,277,551	-	117	-	-	40,277,868	55.71
(二)交換(Swaps)	27,002,874	1,238,747	18,425	10,950	37,803	-	28,308,799	39.15
(三)買入選擇權(Bought Options)	879,299	830,550	5,365	4,579	-	-	1,719,793	2.38
(四)賣出選擇權(Sold Options)	1,026,098	839,214	6,481	4,554	-	-	1,876,347	2.60
二、交易所(Exchange-traded Contracts)	108,913	654	5,554	116	-	-	115,237	0.16
(一)期貨-長部位(Futures-Long Positions)	13,114	333	1,007	71	-	-	14,525	0.02
(二)期貨-短部位(Futures-Short Positions)	95,799	321	3,681	45	-	-	99,846	0.14
(三)買入選擇權(Bought Options)	-	-	245	-	-	-	245	0.00
(四)賣出選擇權(Sold Options)	-	-	621	-	-	-	621	0.00
合 計	29,017,384	43,186,716	35,825	20,316	37,803	-	72,298,044	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	28,607,487	42,965,218	35,825	20,316	37,803	-	71,666,649	99.13
二、非交易目的	409,897	221,498	-	-	-	-	631,395	0.87
合 計	29,017,384	43,186,716	35,825	20,316	37,803	-	72,298,044	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	112年3月底		111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)	72,182,807	99.84	70,191,602	99.77	1,991,205	2.84
(一)遠期契約(Forwards)	40,277,868	55.71	38,906,712	55.30	1,371,156	3.52
(二)交換(Swaps)	28,308,799	39.15	28,040,479	39.86	268,320	0.96
(三)買入選擇權(Bought Options)	1,719,793	2.38	1,568,233	2.23	151,560	9.66
(四)賣出選擇權(Sold Options)	1,876,347	2.60	1,676,178	2.38	200,169	11.94
二、交易所(Exchange-traded Contracts)	115,237	0.16	163,253	0.23	-48,016	-29.41
(一)期貨-長部位(Futures-Long Positions)	14,525	0.02	49,125	0.07	-34,600	-70.43
(二)期貨-短部位(Futures-Short Positions)	99,846	0.14	113,030	0.16	-13,184	-11.66
(三)買入選擇權(Bought Options)	245	0.00	257	0.00	-12	-4.67
(四)賣出選擇權(Sold Options)	621	0.00	841	0.00	-220	-26.16
合 計	72,298,044	100.00	70,354,855	100.00	1,943,189	2.76

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)。