

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)	29,164,700	43,143,238	31,945	14,482	33,889	-	72,388,254	99.81
(一)遠期契約(Forwards)	-	40,413,557	-	270	-	-	40,413,827	55.72
(二)交換(Swaps)	27,237,511	1,182,577	19,100	5,654	33,889	-	28,478,731	39.27
(三)買入選擇權(Bought Options)	896,911	766,889	5,891	4,279	-	-	1,673,970	2.31
(四)賣出選擇權(Sold Options)	1,030,278	780,215	6,954	4,279	-	-	1,821,726	2.51
二、交易所(Exchange-traded Contracts)	130,100	180	8,406	159	-	-	138,845	0.19
(一)期貨-長部位(Futures-Long Positions)	64,422	97	808	99	-	-	65,426	0.09
(二)期貨-短部位(Futures-Short Positions)	65,678	83	7,279	60	-	-	73,100	0.10
(三)買入選擇權(Bought Options)	-	-	185	-	-	-	185	0.00
(四)賣出選擇權(Sold Options)	-	-	134	-	-	-	134	0.00
合 計	29,294,800	43,143,418	40,351	14,641	33,889	-	72,527,099	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	28,874,422	42,971,576	40,351	14,641	33,889	-	71,934,879	99.18
二、非交易目的	420,378	171,842	-	-	-	-	592,220	0.82
合 計	29,294,800	43,143,418	40,351	14,641	33,889	-	72,527,099	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6月底		112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)	72,388,254	99.81	72,182,807	99.84	205,447	0.28
(一)遠期契約(Forwards)	40,413,827	55.72	40,277,868	55.71	135,959	0.34
(二)交換(Swaps)	28,478,731	39.27	28,308,799	39.15	169,932	0.60
(三)買入選擇權(Bought Options)	1,673,970	2.31	1,719,793	2.38	-45,823	-2.66
(四)賣出選擇權(Sold Options)	1,821,726	2.51	1,876,347	2.60	-54,621	-2.91
二、交易所(Exchange-traded Contracts)	138,845	0.19	115,237	0.16	23,608	20.49
(一)期貨-長部位(Futures-Long Positions)	65,426	0.09	14,525	0.02	50,901	350.44
(二)期貨-短部位(Futures-Short Positions)	73,100	0.10	99,846	0.14	-26,746	-26.79
(三)買入選擇權(Bought Options)	185	0.00	245	0.00	-60	-24.49
(四)賣出選擇權(Sold Options)	134	0.00	621	0.00	-487	-78.42
合 計	72,527,099	100.00	72,298,044	100.00	229,055	0.32

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)。