

# 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
<b>一、店頭市場(OTC)</b>	<b>28,944,019</b>	<b>45,552,239</b>	<b>43,021</b>	<b>14,865</b>	<b>37,809</b>	-	<b>74,591,953</b>	<b>99.64</b>
(一)遠期契約(Forwards)	-	42,695,209	-	28	-	-	42,695,237	57.03
(二)交換(Swaps)	26,962,164	1,003,244	24,253	9,335	37,809	-	28,036,805	37.45
(三)買入選擇權(Bought Options)	922,867	914,267	8,918	2,751	-	-	1,848,803	2.47
(四)賣出選擇權(Sold Options)	1,058,988	939,519	9,850	2,751	-	-	2,011,108	2.69
<b>二、交易所(Exchange-traded Contracts)</b>	<b>258,343</b>	<b>669</b>	<b>11,029</b>	<b>134</b>	-	-	<b>270,175</b>	<b>0.36</b>
(一)期貨-長部位(Futures-Long Positions)	81,543	390	1,515	36	-	-	83,484	0.11
(二)期貨-短部位(Futures-Short Positions)	176,800	279	8,722	98	-	-	185,899	0.25
(三)買入選擇權(Bought Options)	-	-	365	-	-	-	365	0.00
(四)賣出選擇權(Sold Options)	-	-	427	-	-	-	427	0.00
<b>合計</b>	<b>29,202,362</b>	<b>45,552,908</b>	<b>54,050</b>	<b>14,999</b>	<b>37,809</b>	-	<b>74,862,128</b>	<b>100.00</b>

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
<b>一、交易目的</b>	<b>28,773,454</b>	<b>45,396,309</b>	<b>54,050</b>	<b>14,999</b>	<b>37,809</b>	-	<b>74,276,621</b>	<b>99.22</b>
<b>二、非交易目的</b>	<b>428,908</b>	<b>156,599</b>	-	-	-	-	<b>585,507</b>	<b>0.78</b>
<b>合計</b>	<b>29,202,362</b>	<b>45,552,908</b>	<b>54,050</b>	<b>14,999</b>	<b>37,809</b>	-	<b>74,862,128</b>	<b>100.00</b>

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9月底		112年6月底		比較增減	
	金額	比重	金額	比重	金額	變動率
<b>一、店頭市場(OTC)</b>	<b>74,591,953</b>	<b>99.64</b>	<b>72,388,254</b>	<b>99.81</b>	<b>2,203,699</b>	<b>3.04</b>
(一)遠期契約(Forwards)	42,695,237	57.03	40,413,827	55.72	2,281,410	5.65
(二)交換(Swaps)	28,036,805	37.45	28,478,731	39.27	-441,926	-1.55
(三)買入選擇權(Bought Options)	1,848,803	2.47	1,673,970	2.31	174,833	10.44
(四)賣出選擇權(Sold Options)	2,011,108	2.69	1,821,726	2.51	189,382	10.40
<b>二、交易所(Exchange-traded Contracts)</b>	<b>270,175</b>	<b>0.36</b>	<b>138,845</b>	<b>0.19</b>	<b>131,330</b>	<b>94.59</b>
(一)期貨-長部位(Futures-Long Positions)	83,484	0.11	65,426	0.09	18,058	27.60
(二)期貨-短部位(Futures-Short Positions)	185,899	0.25	73,100	0.10	112,799	154.31
(三)買入選擇權(Bought Options)	365	0.00	185	0.00	180	97.30
(四)賣出選擇權(Sold Options)	427	0.00	134	0.00	293	218.66
<b>合 計</b>	<b>74,862,128</b>	<b>100.00</b>	<b>72,527,099</b>	<b>100.00</b>	<b>2,335,029</b>	<b>3.22</b>

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)。