

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)	29,797,079	44,115,382	39,259	12,569	31,999	-	73,996,288	99.86
(一)遠期契約(Forwards)	-	41,447,850	-	-	-	-	41,447,850	55.93
(二)交換(Swaps)	27,890,541	893,742	21,338	7,165	31,999	-	28,844,785	38.93
(三)買入選擇權(Bought Options)	896,848	875,926	8,668	2,702	-	-	1,784,144	2.41
(四)賣出選擇權(Sold Options)	1,009,690	897,864	9,253	2,702	-	-	1,919,509	2.59
二、交易所(Exchange-traded Contracts)	100,013	103	7,215	131	-	-	107,462	0.14
(一)期貨-長部位(Futures-Long Positions)	24,192	30	369	120	-	-	24,711	0.03
(二)期貨-短部位(Futures-Short Positions)	75,821	73	6,619	11	-	-	82,524	0.11
(三)買入選擇權(Bought Options)	-	-	227	-	-	-	227	0.00
(四)賣出選擇權(Sold Options)	-	-	-	-	-	-	-	0.00
合計	29,897,092	44,115,485	46,474	12,700	31,999	-	74,103,750	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	29,475,294	43,700,045	46,474	12,700	31,999	-	73,266,512	98.87
二、非交易目的	421,798	415,440	-	-	-	-	837,238	1.13
合計	29,897,092	44,115,485	46,474	12,700	31,999	-	74,103,750	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12月底		112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)	73,996,288	99.86	74,591,953	99.64	-595,665	-0.80
(一)遠期契約(Forwards)	41,447,850	55.93	42,695,237	57.03	-1,247,387	-2.92
(二)交換(Swaps)	28,844,785	38.93	28,036,805	37.45	807,980	2.88
(三)買入選擇權(Bought Options)	1,784,144	2.41	1,848,803	2.47	-64,659	-3.50
(四)賣出選擇權(Sold Options)	1,919,509	2.59	2,011,108	2.69	-91,599	-4.55
二、交易所(Exchange-traded Contracts)	107,462	0.14	270,175	0.36	-162,713	-60.23
(一)期貨-長部位(Futures-Long Positions)	24,711	0.03	83,484	0.11	-58,773	-70.40
(二)期貨-短部位(Futures-Short Positions)	82,524	0.11	185,899	0.25	-103,375	-55.61
(三)買入選擇權(Bought Options)	227	0.00	365	0.00	-138	-37.81
(四)賣出選擇權(Sold Options)	-	0.00	427	0.00	-427	-100.00
合 計	74,103,750	100.00	74,862,128	100.00	-758,378	-1.01

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)。