

# 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
<b>一、店頭市場(OTC)</b>	<b>29,797,079</b>	<b>44,115,382</b>	<b>39,259</b>	<b>12,569</b>	<b>31,999</b>	-	<b>73,996,288</b>	<b>99.86</b>
(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
<b>二、交易所(Exchange-traded Contracts)</b>	<b>100,013</b>	<b>103</b>	<b>7,215</b>	<b>131</b>	-	-	<b>107,462</b>	<b>0.14</b>
(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
<b>合計</b>	<b>29,897,092</b>	<b>44,115,485</b>	<b>46,474</b>	<b>12,700</b>	<b>31,999</b>	-	<b>74,103,750</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>29,475,294</b>	<b>43,700,045</b>	<b>46,474</b>	<b>12,700</b>	<b>31,999</b>	-	<b>73,266,512</b>	<b>98.87</b>
<b>二、非交易目的</b>	<b>421,798</b>	<b>415,440</b>	-	-	-	-	<b>837,238</b>	<b>1.13</b>
<b>合計</b>	<b>29,897,092</b>	<b>44,115,485</b>	<b>46,474</b>	<b>12,700</b>	<b>31,999</b>	-	<b>74,103,750</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
<b>一、店頭市場(OTC)</b>	<b>73,996,288</b>	<b>99.86</b>	<b>74,591,953</b>	<b>99.64</b>	<b>-595,665</b>	<b>-0.80</b>
(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
<b>二、交易所(Exchange-traded Contracts)</b>	<b>107,462</b>	<b>0.14</b>	<b>270,175</b>	<b>0.36</b>	<b>-162,713</b>	<b>-60.23</b>
(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
<b>合 計</b>	<b>74,103,750</b>	<b>100.00</b>	<b>74,862,128</b>	<b>100.00</b>	<b>-758,378</b>	<b>-1.01</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)。