

附表1 銀行衍生性金融商品未結清契約名目本金餘額

113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)	32,737,463	48,410,819	46,831	11,241	33,213	-	81,239,567	99.63
(一)遠期契約(Forwards)	250	45,277,578	-	-	-	-	45,277,828	55.53
(二)交換(Swaps)	30,860,722	911,187	25,689	5,441	33,213	-	31,836,252	39.04
(三)買入選擇權(Bought Options)	886,131	1,086,804	10,236	2,900	-	-	1,986,071	2.44
(四)賣出選擇權(Sold Options)	990,360	1,135,250	10,906	2,900	-	-	2,139,416	2.62
二、交易所(Exchange-traded Contracts)	290,574	2,332	12,183	55	-	-	305,144	0.37
(一)期貨-長部位(Futures-Long Positions)	134,032	1,266	1,002	51	-	-	136,351	0.17
(二)期貨-短部位(Futures-Short Positions)	156,542	1,066	10,286	4	-	-	167,898	0.20
(三)買入選擇權(Bought Options)	-	-	501	-	-	-	501	0.00
(四)賣出選擇權(Sold Options)	-	-	394	-	-	-	394	0.00
合計	33,028,037	48,413,151	59,014	11,296	33,213	-	81,544,711	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	32,577,257	48,129,361	59,014	11,296	33,213	-	80,810,141	99.10
二、非交易目的	450,780	283,790	-	-	-	-	734,570	0.90
合計	33,028,037	48,413,151	59,014	11,296	33,213	-	81,544,711	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	113年3月底		112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)	81,239,567	99.63	73,996,288	99.86	7,243,279	9.79
(一)遠期契約(Forwards)	45,277,828	55.53	41,447,850	55.93	3,829,978	9.24
(二)交換(Swaps)	31,836,252	39.04	28,844,785	38.93	2,991,467	10.37
(三)買入選擇權(Bought Options)	1,986,071	2.44	1,784,144	2.41	201,927	11.32
(四)賣出選擇權(Sold Options)	2,139,416	2.62	1,919,509	2.59	219,907	11.46
二、交易所(Exchange-traded Contracts)	305,144	0.37	107,462	0.14	197,682	183.96
(一)期貨-長部位(Futures-Long Positions)	136,351	0.17	24,711	0.03	111,640	451.78
(二)期貨-短部位(Futures-Short Positions)	167,898	0.20	82,524	0.11	85,374	103.45
(三)買入選擇權(Bought Options)	501	0.00	227	0.00	274	120.70
(四)賣出選擇權(Sold Options)	394	0.00	-	0.00	394	-
合 計	81,544,711	100.00	74,103,750	100.00	7,440,961	10.04

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)。