

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)	35,121,918	50,237,238	48,086	14,823	31,092	-	85,453,157	99.78
(一)遠期契約(Forwards)	-	46,832,270	-	301	-	-	46,832,571	54.68
(二)交換(Swaps)	33,146,490	971,716	26,424	6,844	31,092	-	34,182,566	39.91
(三)買入選擇權(Bought Options)	948,012	1,182,500	10,450	3,839	-	-	2,144,801	2.51
(四)賣出選擇權(Sold Options)	1,027,416	1,250,752	11,212	3,839	-	-	2,293,219	2.68
二、交易所(Exchange-traded Contracts)	169,489	2,247	19,586	80	-	-	191,402	0.22
(一)期貨-長部位(Futures-Long Positions)	93,804	1,162	1,436	55	-	-	96,457	0.11
(二)期貨-短部位(Futures-Short Positions)	75,685	1,085	17,609	25	-	-	94,404	0.11
(三)買入選擇權(Bought Options)	-	-	239	-	-	-	239	0.00
(四)賣出選擇權(Sold Options)	-	-	302	-	-	-	302	0.00
合計	35,291,407	50,239,485	67,672	14,903	31,092	-	85,644,559	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	34,858,931	49,995,492	67,672	14,903	31,092	-	84,968,090	99.21
二、非交易目的	432,476	243,993	-	-	-	-	676,469	0.79
合計	35,291,407	50,239,485	67,672	14,903	31,092	-	85,644,559	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6月底		113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)	85,453,157	99.78	81,239,567	99.63	4,213,590	5.19
(一)遠期契約(Forwards)	46,832,571	54.68	45,277,828	55.53	1,554,743	3.43
(二)交換(Swaps)	34,182,566	39.91	31,836,252	39.04	2,346,314	7.37
(三)買入選擇權(Bought Options)	2,144,801	2.51	1,986,071	2.44	158,730	7.99
(四)賣出選擇權(Sold Options)	2,293,219	2.68	2,139,416	2.62	153,803	7.19
二、交易所(Exchange-traded Contracts)	191,402	0.22	305,144	0.37	-113,742	-37.27
(一)期貨-長部位(Futures-Long Positions)	96,457	0.11	136,351	0.17	-39,894	-29.26
(二)期貨-短部位(Futures-Short Positions)	94,404	0.11	167,898	0.20	-73,494	-43.77
(三)買入選擇權(Bought Options)	239	0.00	501	0.00	-262	-52.30
(四)賣出選擇權(Sold Options)	302	0.00	394	0.00	-92	-23.35
合 計	85,644,559	100.00	81,544,711	100.00	4,099,848	5.03

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)。