

# 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
<b>一、店頭市場(OTC)</b>	<b>35,121,918</b>	<b>50,237,238</b>	<b>48,086</b>	<b>14,823</b>	<b>31,092</b>	-	<b>85,453,157</b>	<b>99.78</b>
(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
<b>二、交易所(Exchange-traded Contracts)</b>	<b>169,489</b>	<b>2,247</b>	<b>19,586</b>	<b>80</b>	-	-	<b>191,402</b>	<b>0.22</b>
(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
<b>合計</b>	<b>35,291,407</b>	<b>50,239,485</b>	<b>67,672</b>	<b>14,903</b>	<b>31,092</b>	-	<b>85,644,559</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>34,858,931</b>	<b>49,995,492</b>	<b>67,672</b>	<b>14,903</b>	<b>31,092</b>	-	<b>84,968,090</b>	<b>99.21</b>
<b>二、非交易目的</b>	<b>432,476</b>	<b>243,993</b>	-	-	-	-	<b>676,469</b>	<b>0.79</b>
<b>合計</b>	<b>35,291,407</b>	<b>50,239,485</b>	<b>67,672</b>	<b>14,903</b>	<b>31,092</b>	-	<b>85,644,559</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	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
<b>一、店頭市場(OTC)</b>	<b>85,453,157</b>	<b>99.78</b>	<b>81,239,567</b>	<b>99.63</b>	<b>4,213,590</b>	<b>5.19</b>
(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
<b>二、交易所(Exchange-traded Contracts)</b>	<b>191,402</b>	<b>0.22</b>	<b>305,144</b>	<b>0.37</b>	<b>-113,742</b>	<b>-37.27</b>
(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
<b>合 計</b>	<b>85,644,559</b>	<b>100.00</b>	<b>81,544,711</b>	<b>100.00</b>	<b>4,099,848</b>	<b>5.03</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)。