

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9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)	39,771,062	48,874,915	45,697	22,990	33,771	-	88,748,435	99.82
(一)遠期契約(Forwards)	100	45,156,140	-	152	-	-	45,156,392	50.79
(二)交換(Swaps)	37,779,643	991,439	25,501	17,821	33,771	-	38,848,175	43.70
(三)買入選擇權(Bought Options)	946,288	1,337,151	9,859	2,522	-	-	2,295,820	2.58
(四)賣出選擇權(Sold Options)	1,045,031	1,390,185	10,337	2,495	-	-	2,448,048	2.75
二、交易所(Exchange-traded Contracts)	135,529	168	18,731	58	-	-	154,486	0.18
(一)期貨-長部位(Futures-Long Positions)	90,406	17	3,275	44	-	-	93,742	0.11
(二)期貨-短部位(Futures-Short Positions)	43,724	151	14,580	14	-	-	58,469	0.07
(三)買入選擇權(Bought Options)	687	-	45	-	-	-	732	0.00
(四)賣出選擇權(Sold Options)	712	-	831	-	-	-	1,543	0.00
合 計	39,906,591	48,875,083	64,428	23,048	33,771	-	88,902,921	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	39,466,171	48,607,385	64,428	23,048	33,771	-	88,194,803	99.20
二、非交易目的	440,420	267,698	-	-	-	-	708,118	0.80
合 計	39,906,591	48,875,083	64,428	23,048	33,771	-	88,902,921	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9月底		113年6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)	88,748,435	99.82	85,453,157	99.78	3,295,278	3.86
(一)遠期契約(Forwards)	45,156,392	50.79	46,832,571	54.68	-1,676,179	-3.58
(二)交換(Swaps)	38,848,175	43.70	34,182,566	39.91	4,665,609	13.65
(三)買入選擇權(Bought Options)	2,295,820	2.58	2,144,801	2.51	151,019	7.04
(四)賣出選擇權(Sold Options)	2,448,048	2.75	2,293,219	2.68	154,829	6.75
二、交易所(Exchange-traded Contracts)	154,486	0.18	191,402	0.22	-36,916	-19.29
(一)期貨-長部位(Futures-Long Positions)	93,742	0.11	96,457	0.11	-2,715	-2.81
(二)期貨-短部位(Futures-Short Positions)	58,469	0.07	94,404	0.11	-35,935	-38.07
(三)買入選擇權(Bought Options)	732	0.00	239	0.00	493	206.28
(四)賣出選擇權(Sold Options)	1,543	0.00	302	0.00	1,241	410.93
合 計	88,902,921	100.00	85,644,559	100.00	3,258,362	3.80

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)。