

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
一、店頭市場(OTC)	42,024,607	46,968,121	36,971	24,758	30,682	-	89,085,139	99.71
(一)遠期契約(Forwards)	-	43,270,508	-	-	-	-	43,270,508	48.43
(二)交換(Swaps)	39,973,148	1,066,447	20,636	19,566	30,682	-	41,110,479	46.01
(三)買入選擇權(Bought Options)	966,062	1,278,660	7,942	2,596	-	-	2,255,260	2.53
(四)賣出選擇權(Sold Options)	1,085,397	1,352,506	8,393	2,596	-	-	2,448,892	2.74
二、交易所(Exchange-traded Contracts)	251,569	315	9,903	11	-	-	261,798	0.29
(一)期貨-長部位(Futures-Long Positions)	113,903	82	403	-	-	-	114,388	0.13
(二)期貨-短部位(Futures-Short Positions)	136,236	233	8,659	11	-	-	145,139	0.16
(三)買入選擇權(Bought Options)	712	-	32	-	-	-	744	0.00
(四)賣出選擇權(Sold Options)	718	-	809	-	-	-	1,527	0.00
合 計	42,276,176	46,968,436	46,874	24,769	30,682	-	89,346,937	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	41,814,524	46,513,510	46,874	24,769	30,682	-	88,430,359	98.97
二、非交易目的	461,652	454,926	-	-	-	-	916,578	1.03
合 計	42,276,176	46,968,436	46,874	24,769	30,682	-	89,346,937	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12月底		113年9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)	89,085,139	99.71	88,748,435	99.82	336,704	0.38
(一)遠期契約(Forwards)	43,270,508	48.43	45,156,392	50.79	-1,885,884	-4.18
(二)交換(Swaps)	41,110,479	46.01	38,848,175	43.70	2,262,304	5.82
(三)買入選擇權(Bought Options)	2,255,260	2.53	2,295,820	2.58	-40,560	-1.77
(四)賣出選擇權(Sold Options)	2,448,892	2.74	2,448,048	2.75	844	0.03
二、交易所(Exchange-traded Contracts)	261,798	0.29	154,486	0.18	107,312	69.46
(一)期貨-長部位(Futures-Long Positions)	114,388	0.13	93,742	0.11	20,646	22.02
(二)期貨-短部位(Futures-Short Positions)	145,139	0.16	58,469	0.07	86,670	148.23
(三)買入選擇權(Bought Options)	744	0.00	732	0.00	12	1.64
(四)賣出選擇權(Sold Options)	1,527	0.00	1,543	0.00	-16	-1.04
合 計	89,346,937	100.00	88,902,921	100.00	444,016	0.50

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)。