

附表1 銀行衍生性金融商品未結清契約名目本金餘額

114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)	44,862,370	48,217,273	39,321	20,272	38,717	-	93,177,953	99.83
(一)遠期契約(Forwards)	800	44,641,070	-	100	-	-	44,641,970	47.83
(二)交換(Swaps)	42,721,719	1,140,040	22,574	14,380	38,717	-	43,937,430	47.07
(三)買入選擇權(Bought Options)	1,007,222	1,163,272	8,234	2,896	-	-	2,181,624	2.34
(四)賣出選擇權(Sold Options)	1,132,629	1,272,891	8,513	2,896	-	-	2,416,929	2.59
二、交易所(Exchange-traded Contracts)	136,336	330	20,855	13	-	-	157,534	0.17
(一)期貨-長部位(Futures-Long Positions)	50,886	110	1,111	10	-	-	52,117	0.06
(二)期貨-短部位(Futures-Short Positions)	85,267	220	17,332	3	-	-	102,822	0.11
(三)買入選擇權(Bought Options)	-	-	966	-	-	-	966	0.00
(四)賣出選擇權(Sold Options)	183	-	1,446	-	-	-	1,629	0.00
合 計	44,998,706	48,217,603	60,176	20,285	38,717	-	93,335,487	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	44,518,095	47,898,821	60,176	20,285	38,717	-	92,536,094	99.14
二、非交易目的	480,611	318,782	-	-	-	-	799,393	0.86
合 計	44,998,706	48,217,603	60,176	20,285	38,717	-	93,335,487	100.00

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	114年3月底		113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)	93,177,953	99.83	89,085,139	99.71	4,092,814	4.59
(一)遠期契約(Forwards)	44,641,970	47.83	43,270,508	48.43	1,371,462	3.17
(二)交換(Swaps)	43,937,430	47.07	41,110,479	46.01	2,826,951	6.88
(三)買入選擇權(Bought Options)	2,181,624	2.34	2,255,260	2.53	-73,636	-3.27
(四)賣出選擇權(Sold Options)	2,416,929	2.59	2,448,892	2.74	-31,963	-1.31
二、交易所(Exchange-traded Contracts)	157,534	0.17	261,798	0.29	-104,264	-39.83
(一)期貨-長部位(Futures-Long Positions)	52,117	0.06	114,388	0.13	-62,271	-54.44
(二)期貨-短部位(Futures-Short Positions)	102,822	0.11	145,139	0.16	-42,317	-29.16
(三)買入選擇權(Bought Options)	966	0.00	744	0.00	222	29.84
(四)賣出選擇權(Sold Options)	1,629	0.00	1,527	0.00	102	6.68
合 計	93,335,487	100.00	89,346,937	100.00	3,988,550	4.46

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)。