

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)	45,885,230	40,805,515	27,103	16,373	38,498	-	86,772,719	99.82
(一)遠期契約(Forwards)	100	37,515,770	-	89	-	-	37,515,959	43.16
(二)交換(Swaps)	43,858,307	1,106,610	16,127	12,860	38,498	-	45,032,402	51.80
(三)買入選擇權(Bought Options)	973,643	1,046,234	5,308	1,700	-	-	2,026,885	2.33
(四)賣出選擇權(Sold Options)	1,053,180	1,136,901	5,668	1,724	-	-	2,197,473	2.53
二、交易所(Exchange-traded Contracts)	139,684	884	14,385	214	-	-	155,167	0.18
(一)期貨-長部位(Futures-Long Positions)	71,441	528	1,267	98	-	-	73,334	0.09
(二)期貨-短部位(Futures-Short Positions)	67,918	356	11,333	116	-	-	79,723	0.09
(三)買入選擇權(Bought Options)	-	-	667	-	-	-	667	0.00
(四)賣出選擇權(Sold Options)	325	-	1,118	-	-	-	1,443	0.00
合 計	46,024,914	40,806,399	41,488	16,587	38,498	-	86,927,886	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	45,572,482	40,580,605	41,488	16,587	38,498	-	86,249,660	99.22
二、非交易目的	452,432	225,794	-	-	-	-	678,226	0.78
合 計	46,024,914	40,806,399	41,488	16,587	38,498	-	86,927,886	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6月底		114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)	86,772,719	99.82	93,177,953	99.83	-6,405,234	-6.87
(一)遠期契約(Forwards)	37,515,959	43.16	44,641,970	47.83	-7,126,011	-15.96
(二)交換(Swaps)	45,032,402	51.80	43,937,430	47.07	1,094,972	2.49
(三)買入選擇權(Bought Options)	2,026,885	2.33	2,181,624	2.34	-154,739	-7.09
(四)賣出選擇權(Sold Options)	2,197,473	2.53	2,416,929	2.59	-219,456	-9.08
二、交易所(Exchange-traded Contracts)	155,167	0.18	157,534	0.17	-2,367	-1.50
(一)期貨-長部位(Futures-Long Positions)	73,334	0.09	52,117	0.06	21,217	40.71
(二)期貨-短部位(Futures-Short Positions)	79,723	0.09	102,822	0.11	-23,099	-22.47
(三)買入選擇權(Bought Options)	667	0.00	966	0.00	-299	-30.95
(四)賣出選擇權(Sold Options)	1,443	0.00	1,629	0.00	-186	-11.42
合 計	86,927,886	100.00	93,335,487	100.00	-6,407,601	-6.87

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)。