

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)	48,140,218	44,247,035	35,936	15,232	38,419	-	92,476,840	99.82
(一)遠期契約(Forwards)	-	40,647,551	-	33	-	-	40,647,584	43.87
(二)交換(Swaps)	46,048,103	1,185,231	20,285	10,851	38,419	-	47,302,889	51.06
(三)買入選擇權(Bought Options)	1,011,938	1,175,811	7,321	2,159	-	-	2,197,229	2.37
(四)賣出選擇權(Sold Options)	1,080,177	1,238,442	8,330	2,189	-	-	2,329,138	2.52
二、交易所(Exchange-traded Contracts)	158,137	712	11,378	19	-	-	170,246	0.18
(一)期貨-長部位(Futures-Long Positions)	104,764	672	2,215	-	-	-	107,651	0.12
(二)期貨-短部位(Futures-Short Positions)	52,724	40	5,391	19	-	-	58,174	0.06
(三)買入選擇權(Bought Options)	-	-	1,170	-	-	-	1,170	0.00
(四)賣出選擇權(Sold Options)	649	-	2,602	-	-	-	3,251	0.00
合 計	48,298,355	44,247,747	47,314	15,251	38,419	-	92,647,086	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	47,775,496	44,006,830	47,314	15,251	14,459	-	91,859,350	99.15
二、非交易目的	522,859	240,917	-	-	23,960	-	787,736	0.85
合 計	48,298,355	44,247,747	47,314	15,251	38,419	-	92,647,086	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9月底		114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)	92,476,840	99.82	86,772,719	99.82	5,704,121	6.57
(一)遠期契約(Forwards)	40,647,584	43.87	37,515,959	43.16	3,131,625	8.35
(二)交換(Swaps)	47,302,889	51.06	45,032,402	51.80	2,270,487	5.04
(三)買入選擇權(Bought Options)	2,197,229	2.37	2,026,885	2.33	170,344	8.40
(四)賣出選擇權(Sold Options)	2,329,138	2.52	2,197,473	2.53	131,665	5.99
二、交易所(Exchange-traded Contracts)	170,246	0.18	155,167	0.18	15,079	9.72
(一)期貨-長部位(Futures-Long Positions)	107,651	0.12	73,334	0.09	34,317	46.80
(二)期貨-短部位(Futures-Short Positions)	58,174	0.06	79,723	0.09	-21,549	-27.03
(三)買入選擇權(Bought Options)	1,170	0.00	667	0.00	503	75.41
(四)賣出選擇權(Sold Options)	3,251	0.00	1,443	0.00	1,808	125.29
合 計	92,647,086	100.00	86,927,886	100.00	5,719,200	6.58

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)。