

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)	51,725,819	42,806,081	45,552	18,580	38,645	-	94,634,677	99.84
(一)遠期契約(Forwards)	-	39,305,671	-	-	-	-	39,305,671	41.47
(二)交換(Swaps)	49,593,656	1,146,265	25,124	7,215	38,645	-	50,810,905	53.61
(三)買入選擇權(Bought Options)	1,013,737	1,144,870	9,641	5,669	-	-	2,173,917	2.29
(四)賣出選擇權(Sold Options)	1,118,426	1,209,275	10,787	5,696	-	-	2,344,184	2.47
二、交易所(Exchange-traded Contracts)	129,545	779	17,834	97	-	-	148,255	0.16
(一)期貨-長部位(Futures-Long Positions)	76,069	601	2,072	83	-	-	78,825	0.09
(二)期貨-短部位(Futures-Short Positions)	53,476	178	13,589	14	-	-	67,257	0.07
(三)買入選擇權(Bought Options)	-	-	68	-	-	-	68	0.00
(四)賣出選擇權(Sold Options)	-	-	2,105	-	-	-	2,105	0.00
合 計	51,855,364	42,806,860	63,386	18,677	38,645	-	94,782,932	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	51,290,280	42,570,574	63,386	18,677	13,622	-	93,956,539	99.13
二、非交易目的	565,084	236,286	-	-	25,023	-	826,393	0.87
合 計	51,855,364	42,806,860	63,386	18,677	38,645	-	94,782,932	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12月底		114年月9底		比較增減	
	金額	比重	金額	比重	金額	變動率
一、店頭市場(OTC)	94,634,677	99.84	92,476,840	99.82	2,157,837	2.33
(一)遠期契約(Forwards)	39,305,671	41.47	40,647,584	43.87	-1,341,913	-3.30
(二)交換(Swaps)	50,810,905	53.61	47,302,889	51.06	3,508,016	7.42
(三)買入選擇權(Bought Options)	2,173,917	2.29	2,197,229	2.37	-23,312	-1.06
(四)賣出選擇權(Sold Options)	2,344,184	2.47	2,329,138	2.52	15,046	0.65
二、交易所(Exchange-traded Contracts)	148,255	0.16	170,246	0.18	-21,991	-12.92
(一)期貨-長部位(Futures-Long Positions)	78,825	0.09	107,651	0.12	-28,826	-26.78
(二)期貨-短部位(Futures-Short Positions)	67,257	0.07	58,174	0.06	9,083	15.61
(三)買入選擇權(Bought Options)	68	0.00	1,170	0.00	-1,102	-94.19
(四)賣出選擇權(Sold Options)	2,105	0.00	3,251	0.00	-1,146	-35.25
合 計	94,782,932	100.00	92,647,086	100.00	2,135,846	2.31

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)。