

## 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
<b>一、店頭市場(OTC)</b>	<b>51,725,819</b>	<b>42,806,081</b>	<b>45,552</b>	<b>18,580</b>	<b>38,645</b>	-	<b>94,634,677</b>	<b>99.84</b>
(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
<b>二、交易所(Exchange-traded Contracts)</b>	<b>129,545</b>	<b>779</b>	<b>17,834</b>	<b>97</b>	-	-	<b>148,255</b>	<b>0.16</b>
(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
<b>合 計</b>	<b>51,855,364</b>	<b>42,806,860</b>	<b>63,386</b>	<b>18,677</b>	<b>38,645</b>	-	<b>94,782,932</b>	<b>100.00</b>

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
<b>一、交易目的</b>	<b>51,290,280</b>	<b>42,570,574</b>	<b>63,386</b>	<b>18,677</b>	<b>13,622</b>	-	<b>93,956,539</b>	<b>99.13</b>
<b>二、非交易目的</b>	<b>565,084</b>	<b>236,286</b>	-	-	<b>25,023</b>	-	<b>826,393</b>	<b>0.87</b>
<b>合 計</b>	<b>51,855,364</b>	<b>42,806,860</b>	<b>63,386</b>	<b>18,677</b>	<b>38,645</b>	-	<b>94,782,932</b>	<b>100.00</b>

## 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9月底		比較增減	
	金額	比重	金額	比重	金額	變動率
<b>一、店頭市場(OTC)</b>	<b>94,634,677</b>	<b>99.84</b>	<b>92,476,840</b>	<b>99.82</b>	<b>2,157,837</b>	<b>2.33</b>
(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
<b>二、交易所(Exchange-traded Contracts)</b>	<b>148,255</b>	<b>0.16</b>	<b>170,246</b>	<b>0.18</b>	<b>-21,991</b>	<b>-12.92</b>
(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
<b>合計</b>	<b>94,782,932</b>	<b>100.00</b>	<b>92,647,086</b>	<b>100.00</b>	<b>2,135,846</b>	<b>2.31</b>

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)。