

附表1 銀行衍生性金融商品未結清契約名目本金餘額

115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)	54,752,240	44,409,195	51,698	14,976	42,441	-	99,270,550	99.80
(一)遠期契約(Forwards)	850	40,109,389	-	40	-	-	40,110,279	40.32
(二)交換(Swaps)	52,337,983	1,395,549	29,287	8,323	42,441	-	53,813,583	54.10
(三)買入選擇權(Bought Options)	1,129,320	1,408,861	10,577	3,069	-	-	2,551,827	2.57
(四)賣出選擇權(Sold Options)	1,284,087	1,495,396	11,834	3,544	-	-	2,794,861	2.81
二、交易所(Exchange-traded Contracts)	134,418	1,391	66,872	117	-	-	202,798	0.20
(一)期貨-長部位(Futures-Long Positions)	75,440	1,039	7,365	58	-	-	83,902	0.08
(二)期貨-短部位(Futures-Short Positions)	58,335	352	55,064	59	-	-	113,810	0.12
(三)買入選擇權(Bought Options)	-	-	301	-	-	-	301	0.00
(四)賣出選擇權(Sold Options)	643	-	4,142	-	-	-	4,785	0.00
合計	54,886,658	44,410,586	118,570	15,093	42,441	-	99,473,348	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	54,285,598	44,277,211	118,570	15,093	13,700	-	98,710,172	99.23
二、非交易目的	601,060	133,375	-	-	28,741	-	763,176	0.77
合計	54,886,658	44,410,586	118,570	15,093	42,441	-	99,473,348	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	115年3月底		114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)	99,270,550	99.80	94,634,677	99.84	4,635,873	4.90
(一)遠期契約(Forwards)	40,110,279	40.32	39,305,671	41.47	804,608	2.05
(二)交換(Swaps)	53,813,583	54.10	50,810,905	53.61	3,002,678	5.91
(三)買入選擇權(Bought Options)	2,551,827	2.57	2,173,917	2.29	377,910	17.38
(四)賣出選擇權(Sold Options)	2,794,861	2.81	2,344,184	2.47	450,677	19.23
二、交易所(Exchange-traded Contracts)	202,798	0.20	148,255	0.16	54,543	36.79
(一)期貨-長部位(Futures-Long Positions)	83,902	0.08	78,825	0.09	5,077	6.44
(二)期貨-短部位(Futures-Short Positions)	113,810	0.12	67,257	0.07	46,553	69.22
(三)買入選擇權(Bought Options)	301	0.00	68	0.00	233	342.65
(四)賣出選擇權(Sold Options)	4,785	0.00	2,105	0.00	2,680	127.32
合 計	99,473,348	100.00	94,782,932	100.00	4,690,416	4.95

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)。