

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)	59,889,941	46,159,972	56,075	14,252	39,909	-	106,160,149	99.80
(一)遠期契約(Forwards)	-	41,373,933	-	42	-	-	41,373,975	38.90
(二)交換(Swaps)	57,204,006	1,592,479	34,016	8,603	39,909	-	58,879,013	55.35
(三)買入選擇權(Bought Options)	1,261,528	1,559,465	10,502	2,515	-	-	2,834,010	2.66
(四)賣出選擇權(Sold Options)	1,424,407	1,634,095	11,557	3,092	-	-	3,073,151	2.89
二、交易所(Exchange-traded Contracts)	137,404	1,079	73,491	325	-	-	212,299	0.20
(一)期貨-長部位(Futures-Long Positions)	94,725	794	2,302	196	-	-	98,017	0.09
(二)期貨-短部位(Futures-Short Positions)	42,679	285	60,896	129	-	-	103,989	0.10
(三)買入選擇權(Bought Options)	-	-	791	-	-	-	791	0.00
(四)賣出選擇權(Sold Options)	-	-	9,502	-	-	-	9,502	0.01
合 計	60,027,345	46,161,051	129,566	14,577	39,909	-	106,372,448	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	59,348,155	46,085,617	129,566	14,577	7,389	-	105,585,304	99.26
二、非交易目的	679,190	75,434	-	-	32,520	-	787,144	0.74
合 計	60,027,345	46,161,051	129,566	14,577	39,909	-	106,372,448	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6月底		115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)	106,160,149	99.80	99,270,550	99.80	6,889,599	6.94
(一)遠期契約(Forwards)	41,373,975	38.90	40,110,279	40.32	1,263,696	3.15
(二)交換(Swaps)	58,879,013	55.35	53,813,583	54.10	5,065,430	9.41
(三)買入選擇權(Bought Options)	2,834,010	2.66	2,551,827	2.57	282,183	11.06
(四)賣出選擇權(Sold Options)	3,073,151	2.89	2,794,861	2.81	278,290	9.96
二、交易所(Exchange-traded Contracts)	212,299	0.20	202,798	0.20	9,501	4.68
(一)期貨-長部位(Futures-Long Positions)	98,017	0.09	83,902	0.08	14,115	16.82
(二)期貨-短部位(Futures-Short Positions)	103,989	0.10	113,810	0.12	-9,821	-8.63
(三)買入選擇權(Bought Options)	791	0.00	301	0.00	490	162.79
(四)賣出選擇權(Sold Options)	9,502	0.01	4,785	0.00	4,717	98.58
合 計	106,372,448	100.00	99,473,348	100.00	6,899,100	6.94

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)。