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)	**63,428,691**	**45,790,911**	**66,699**	**13,063**	**42,087**	**-**	**109,341,451**	**99.86**
(一)遠期契約(Forwards)	-	40,980,443	-	-	-	-	40,980,443	37.43
(二)交換(Swaps)	60,678,035	1,563,517	41,595	6,798	42,087	-	62,332,032	56.93
(三)買入選擇權(Bought Options)	1,333,665	1,590,326	11,875	3,079	-	-	2,938,945	2.68
(四)賣出選擇權(Sold Options)	1,416,991	1,656,625	13,229	3,186	-	-	3,090,031	2.82
二、交易所(Exchange-traded Contracts)	**86,396**	**275**	**64,396**	**6**	**-**	**-**	**151,073**	**0.14**
(一)期貨-長部位(Futures-Long Positions)	62,963	262	563	6	-	-	63,794	0.06
(二)期貨-短部位(Futures-Short Positions)	23,433	13	48,528	-	-	-	71,974	0.07
(三)買入選擇權(Bought Options)	-	-	1,123	-	-	-	1,123	0.00
(四)賣出選擇權(Sold Options)	-	-	14,182	-	-	-	14,182	0.01
合　　計	**63,515,087**	**45,791,186**	**131,095**	**13,069**	**42,087**	**-**	**109,492,524**	**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	62,811,160	45,716,284	131,095	13,069	10,031	-	108,681,639	99.26
二、非交易目的	703,927	74,902	-	-	32,056	-	810,885	0.74
合　計	**63,515,087**	**45,791,186**	**131,095**	**13,069**	**42,087**	**-**	**109,492,524**	**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9月底		115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)	**109,341,451**	**99.86**	**106,160,149**	**99.80**	**3,181,302**	**3.00**
(一)遠期契約(Forwards)	40,980,443	37.43	41,373,975	38.90	-393,532	-0.95
(二)交換(Swaps)	62,332,032	56.93	58,879,013	55.35	3,453,019	5.86
(三)買入選擇權(Bought Options)	2,938,945	2.68	2,834,010	2.66	104,935	3.70
(四)賣出選擇權(Sold Options)	3,090,031	2.82	3,073,151	2.89	16,880	0.55
二、交易所(Exchange-traded Contracts)	**151,073**	**0.14**	**212,299**	**0.20**	**-61,226**	**-28.84**
(一)期貨-長部位(Futures-Long Positions)	63,794	0.06	98,017	0.09	-34,223	-34.92
(二)期貨-短部位(Futures-Short Positions)	71,974	0.07	103,989	0.10	-32,015	-30.79
(三)買入選擇權(Bought Options)	1,123	0.00	791	0.00	332	41.97
(四)賣出選擇權(Sold Options)	14,182	0.01	9,502	0.01	4,680	49.25
合　　計	**109,492,524**	**100.00**	**106,372,448**	**100.00**	**3,120,076**	**2.93**

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)。