

**銀行衍生性金融商品名目本金餘額彙總表**  
(單位：新臺幣百萬元)

| 項 目                                 | 87年12月底          | 88年12月底          | 89年12月底          | 90年12月底          | 91年12月底          | 92年12月底           | 93年12月底           |
|-------------------------------------|------------------|------------------|------------------|------------------|------------------|-------------------|-------------------|
| <b>一、名目本金餘額</b>                     | <b>1,688,570</b> | <b>2,145,967</b> | <b>3,104,173</b> | <b>4,724,467</b> | <b>7,285,569</b> | <b>13,562,069</b> | <b>21,777,919</b> |
| (一)店頭市場(OTC)                        | 1,688,570        | 2,145,967        | 3,056,571        | 4,716,885        | 7,274,075        | 13,537,970        | 21,744,959        |
| 1. 遠期契約(Forwards)                   | 748,218          | 847,603          | 1,440,898        | 1,875,632        | 2,299,115        | 3,499,630         | 5,074,444         |
| 2. 交換(Swaps)                        | 602,049          | 858,706          | 968,093          | 1,964,075        | 3,553,941        | 7,506,211         | 12,368,768        |
| 3. 買入選擇權(Bought Options)            | 170,691          | 222,423          | 326,313          | 443,449          | 704,981          | 1,312,586         | 2,007,761         |
| 4. 賣出選擇權(Sold Options)              | 167,612          | 217,235          | 321,267          | 433,729          | 716,038          | 1,219,543         | 2,293,986         |
| (二)交易所(Exchange-traded Contracts)   | 0                | 0                | 47,602           | 7,582            | 11,494           | 24,099            | 32,960            |
| 1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions) | 0                | 0                | 0                | 0                | 697              | 3,546             | 3,286             |
| 2. 期貨-短部位(Futures -Short Positions) | 0                | 0                | 0                | 7,582            | 10,797           | 20,553            | 28,777            |
| 3. 買入選擇權(Bought Options)            | 0                | 0                | 23,801           | 0                | 0                | 0                 | 448               |
| 4. 賣出選擇權(Sold Options)              | 0                | 0                | 23,801           | 0                | 0                | 0                 | 449               |
| <b>二、名目本金餘額</b>                     | <b>1,688,570</b> | <b>2,145,967</b> | <b>3,104,173</b> | <b>4,724,467</b> | <b>7,285,569</b> | <b>13,562,069</b> | <b>21,777,919</b> |
| (一)交易目的之契約總額                        | 1,557,251        | 1,960,701        | 2,943,339        | 4,569,927        | 7,050,100        | 13,099,187        | 20,489,251        |
| (二)非交易目的之契約總額                       | 131,319          | 185,266          | 160,834          | 154,540          | 235,469          | 462,882           | 1,288,668         |

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)及外國銀行(一般分行及國際金融業務分行)。

**銀行衍生性金融商品名目本金餘額彙總表**  
(單位：新臺幣百萬元)

| 項 目                                 | 94年12月底           | 95年12月底           | 96年12月底           | 97年12月底           | 98年12月底           | 99年12月底           | 100年12月底          |
|-------------------------------------|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------|
| <b>一、名目本金餘額</b>                     | <b>30,020,099</b> | <b>40,531,801</b> | <b>54,684,140</b> | <b>59,679,044</b> | <b>63,474,364</b> | <b>51,244,186</b> | <b>49,047,225</b> |
| (一)店頭市場(OTC)                        | 29,971,624        | 40,478,678        | 51,795,153        | 58,683,316        | 62,935,307        | 51,101,629        | 48,984,033        |
| 1. 遠期契約(Forwards)                   | 7,257,529         | 7,809,415         | 9,593,630         | 9,752,834         | 10,440,974        | 12,227,032        | 15,832,820        |
| 2. 交換(Swaps)                        | 17,927,328        | 26,007,906        | 33,253,829        | 41,873,940        | 47,086,904        | 33,993,640        | 28,563,383        |
| 3. 買入選擇權(Bought Options)            | 2,193,957         | 3,101,264         | 4,241,122         | 3,416,784         | 2,682,156         | 2,403,753         | 2,236,029         |
| 4. 賣出選擇權(Sold Options)              | 2,592,810         | 3,560,093         | 4,706,572         | 3,639,758         | 2,725,273         | 2,477,204         | 2,351,801         |
| (二)交易所(Exchange-traded Contracts)   | 48,475            | 53,123            | 2,888,987         | 995,728           | 539,057           | 142,557           | 63,192            |
| 1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions) | 24,399            | 30,542            | 1,384,916         | 484,492           | 227,680           | 37,204            | 17,521            |
| 2. 期貨-短部位(Futures -Short Positions) | 24,076            | 22,167            | 1,488,720         | 494,730           | 213,583           | 77,230            | 39,477            |
| 3. 買入選擇權(Bought Options)            | 0                 | 414               | 7,479             | 13,691            | 85,633            | 16,012            | 4,727             |
| 4. 賣出選擇權(Sold Options)              | 0                 | 0                 | 7,872             | 2,815             | 12,161            | 12,111            | 1,467             |
| <b>二、名目本金餘額</b>                     | <b>30,020,099</b> | <b>40,531,801</b> | <b>54,684,140</b> | <b>59,679,044</b> | <b>63,474,364</b> | <b>51,244,186</b> | <b>49,047,225</b> |
| (一)交易目的之契約總額                        | 29,139,960        | 39,957,903        | 54,373,244        | 59,432,285        | 62,988,300        | 50,892,485        | 48,727,264        |
| (二)非交易目的之契約總額                       | 880,139           | 573,898           | 310,896           | 246,759           | 486,064           | 351,701           | 319,961           |

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)及外國銀行(一般分行及國際金融業務分行)。

**銀行衍生性金融商品名目本金餘額彙總表**  
(單位：新臺幣百萬元)

| 項 目                                 | 101年12月底          | 102年12月底          | 103年3月底           | 103年6月底           | 103年9月底           | 103年12月底          |
|-------------------------------------|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------|
| <b>一、名目本金餘額</b>                     | <b>45,912,332</b> | <b>49,276,370</b> | <b>58,657,052</b> | <b>54,319,999</b> | <b>56,992,547</b> | <b>55,550,224</b> |
| (一)店頭市場(OTC)                        | 45,837,674        | 49,169,298        | 58,494,028        | 54,138,736        | 56,880,331        | 55,474,326        |
| 1. 遠期契約(Forwards)                   | 16,223,455        | 18,763,995        | 20,054,564        | 19,619,585        | 21,804,807        | 23,257,108        |
| 2. 交換(Swaps)                        | 24,710,263        | 21,197,666        | 20,827,448        | 19,280,565        | 19,269,959        | 17,490,551        |
| 3. 買入選擇權(Bought Options)            | 2,405,508         | 4,531,929         | 8,669,137         | 7,506,810         | 7,799,000         | 7,264,387         |
| 4. 賣出選擇權(Sold Options)              | 2,498,448         | 4,675,708         | 8,942,879         | 7,731,776         | 8,006,565         | 7,462,280         |
| (二)交易所(Exchange-traded Contracts)   | 74,658            | 107,072           | 163,024           | 181,263           | 112,216           | 75,898            |
| 1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions) | 1,679             | 23,423            | 31,171            | 57,625            | 21,469            | 13,685            |
| 2. 期貨-短部位(Futures -Short Positions) | 56,946            | 55,623            | 87,453            | 95,114            | 43,613            | 48,061            |
| 3. 買入選擇權(Bought Options)            | 9,400             | 13,505            | 21,659            | 15,842            | 12,614            | 9,585             |
| 4. 賣出選擇權(Sold Options)              | 6,633             | 14,521            | 22,741            | 12,682            | 34,520            | 4,567             |
| <b>二、名目本金餘額</b>                     | <b>45,912,332</b> | <b>49,276,370</b> | <b>58,657,052</b> | <b>54,319,999</b> | <b>56,992,547</b> | <b>55,550,224</b> |
| (一)交易目的之契約總額                        | 45,609,068        | 48,982,277        | 58,393,011        | 54,022,604        | 56,702,815        | 55,305,713        |
| (二)非交易目的之契約總額                       | 303,264           | 294,093           | 264,041           | 297,395           | 289,732           | 244,511           |

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)及外國銀行(一般分行及國際金融業務分行)。

**銀行衍生性金融商品名目本金餘額彙總表**  
(單位：新臺幣百萬元)

| 項 目                                 | 104年3月底           | 104年6月底           | 104年9月底           | 104年12月底          | 105年3月底           | 105年6月底           |
|-------------------------------------|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------|
| <b>一、名目本金餘額</b>                     | <b>56,204,455</b> | <b>55,483,632</b> | <b>58,259,337</b> | <b>55,973,939</b> | <b>54,843,151</b> | <b>53,554,901</b> |
| (一)店頭市場(OTC)                        | 56,114,764        | 55,401,379        | 58,182,328        | 55,898,779        | 54,752,913        | 53,432,516        |
| 1. 遠期契約(Forwards)                   | 23,728,200        | 23,402,516        | 27,403,538        | 27,946,184        | 27,810,135        | 28,425,477        |
| 2. 交換(Swaps)                        | 17,376,365        | 16,337,052        | 16,623,926        | 16,584,172        | 17,494,638        | 17,115,131        |
| 3. 買入選擇權(Bought Options)            | 7,428,247         | 7,744,935         | 6,979,069         | 5,610,104         | 4,640,845         | 3,827,619         |
| 4. 賣出選擇權(Sold Options)              | 7,581,952         | 7,916,876         | 7,175,795         | 5,758,319         | 4,807,295         | 4,064,289         |
| (二)交易所(Exchange-traded Contracts)   | 89,691            | 82,253            | 77,009            | 75,160            | 90,238            | 122,385           |
| 1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions) | 13,645            | 6,318             | 5,789             | 7,714             | 10,965            | 15,689            |
| 2. 期貨-短部位(Futures -Short Positions) | 55,821            | 60,464            | 56,453            | 54,992            | 60,136            | 94,603            |
| 3. 買入選擇權(Bought Options)            | 13,190            | 6,671             | 8,062             | 6,135             | 6,875             | 5,513             |
| 4. 賣出選擇權(Sold Options)              | 7,035             | 8,800             | 6,705             | 6,319             | 12,262            | 6,580             |
| <b>二、名目本金餘額</b>                     | <b>56,204,455</b> | <b>55,483,632</b> | <b>58,259,337</b> | <b>55,973,939</b> | <b>54,843,151</b> | <b>53,554,901</b> |
| (一)交易目的之契約總額                        | 55,961,195        | 55,244,318        | 58,039,348        | 55,763,571        | 54,660,459        | 53,375,316        |
| (二)非交易目的之契約總額                       | 243,260           | 239,314           | 219,989           | 210,368           | 182,692           | 179,585           |

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)及外國銀行(一般分行及國際金融業務分行)。

**銀行衍生性金融商品名目本金餘額彙總表**  
(單位：新臺幣百萬元)

| 項 目                                 | 105年9月底           | 105年12月底          | 106年3月底           |
|-------------------------------------|-------------------|-------------------|-------------------|
| <b>一、名目本金餘額</b>                     | <b>50,020,247</b> | <b>49,927,470</b> | <b>49,603,627</b> |
| (一)店頭市場(OTC)                        | 49,872,711        | 49,802,395        | 49,444,971        |
| 1. 遠期契約(Forwards)                   | 26,802,157        | 27,899,199        | 28,678,705        |
| 2. 交換(Swaps)                        | 16,935,273        | 17,353,671        | 17,071,549        |
| 3. 買入選擇權(Bought Options)            | 2,957,818         | 2,174,992         | 1,697,916         |
| 4. 賣出選擇權(Sold Options)              | 3,177,463         | 2,374,533         | 1,996,801         |
| (二)交易所(Exchange-traded Contracts)   | 147,536           | 125,075           | 158,656           |
| 1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions) | 23,070            | 51,798            | 9,051             |
| 2. 期貨-短部位(Futures -Short Positions) | 109,910           | 60,768            | 131,545           |
| 3. 買入選擇權(Bought Options)            | 6,857             | 6,616             | 9,147             |
| 4. 賣出選擇權(Sold Options)              | 7,699             | 5,893             | 8,913             |
| <b>二、名目本金餘額</b>                     | <b>50,020,247</b> | <b>49,927,470</b> | <b>49,603,627</b> |
| (一)交易目的之契約總額                        | 49,846,744        | 49,751,534        | 49,398,668        |
| (二)非交易目的之契約總額                       | 173,503           | 175,936           | 204,959           |

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)及外國銀行(一般分行及國際金融業務分行)。