

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
一、名日本金餘額	1,688,570	2,145,967	3,104,173	4,724,467	7,285,569	13,562,069	21,777,919
(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
二、名日本金餘額	1,688,570	2,145,967	3,104,173	4,724,467	7,285,569	13,562,069	21,777,919
(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
一、名日本金餘額	30,020,099	40,531,801	54,684,140	59,679,044	63,474,364	51,244,186	49,047,225
(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
二、名日本金餘額	30,020,099	40,531,801	54,684,140	59,679,044	63,474,364	51,244,186	49,047,225
(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
一、名日本金餘額	45,912,332	49,276,370	58,657,052	54,319,999	56,992,547	55,550,224
(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
二、名日本金餘額	45,912,332	49,276,370	58,657,052	54,319,999	56,992,547	55,550,224
(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
一、名日本金餘額	56,204,455	55,483,632	58,259,337	55,973,939	54,843,151	53,554,901
(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
二、名日本金餘額	56,204,455	55,483,632	58,259,337	55,973,939	54,843,151	53,554,901
(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日本金餘額彙總表
(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	106年6月底
一、名日本金餘額	50,020,247	49,927,470	49,603,627	48,062,584
(一)店頭市場(OTC)	49,872,711	49,802,395	49,444,971	47,836,643
1.遠期契約(Forwards)	26,802,157	27,899,199	28,678,705	28,661,100
2.交換(Swaps)	16,935,273	17,353,671	17,071,549	16,371,757
3.買入選擇權(Bought Options)	2,957,818	2,174,992	1,697,916	1,246,676
4.賣出選擇權(Sold Options)	3,177,463	2,374,533	1,996,801	1,557,110
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	147,536	125,075	158,656	225,941
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	23,070	51,798	9,051	83,089
2.期貨-短部位(Futures -Short Positions)	109,910	60,768	131,545	123,208
3.買入選擇權(Bought Options)	6,857	6,616	9,147	8,653
4.賣出選擇權(Sold Options)	7,699	5,893	8,913	10,991
二、名日本金餘額	50,020,247	49,927,470	49,603,627	48,062,584
(一)交易目的之契約總額	49,846,744	49,751,534	49,398,668	47,857,567
(二)非交易目的之契約總額	173,503	175,936	204,959	205,017

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)。