

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	94年12月底
一、名目本金餘額	1,688,570	2,145,967	3,104,173	4,724,467	7,285,569	13,562,069	21,777,919	30,020,099
(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	29,971,624
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	7,257,529
2. 交換(Swaps)	602,049	858,706	968,093	1,964,075	3,553,941	7,506,211	12,368,768	17,927,328
3. 買入選擇權(Bought Options)	170,691	222,423	326,313	443,449	704,981	1,312,586	2,007,761	2,193,957
4. 賣出選擇權(Sold Options)	167,612	217,235	321,267	433,729	716,038	1,219,543	2,293,986	2,592,810
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	0	0	47,602	7,582	11,494	24,099	32,960	48,475
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	0	0	0	0	697	3,546	3,286	24,399
2. 期貨-短部位(Futures -Short Positions)	0	0	0	7,582	10,797	20,553	28,777	24,076
3. 買入選擇權(Bought Options)	0	0	23,801	0	0	0	448	0
4. 賣出選擇權(Sold Options)	0	0	23,801	0	0	0	449	0
二、名目本金餘額	1,688,570	2,145,967	3,104,173	4,724,467	7,285,569	13,562,069	21,777,919	30,020,099
(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	29,139,960
(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	880,139

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	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	101年12月底	102年12月底
一、名目本金餘額	40,531,801	54,684,140	59,679,044	63,474,364	51,244,186	49,047,225	45,912,332	49,276,370
(一)店頭市場(OTC)	40,478,678	51,795,153	58,683,316	62,935,307	51,101,629	48,984,033	45,837,674	49,169,298
1.遠期契約(Forwards)	7,809,415	9,593,630	9,752,834	10,440,974	12,227,032	15,832,820	16,223,455	18,763,995
2.交換(Swaps)	26,007,906	33,253,829	41,873,940	47,086,904	33,993,640	28,563,383	24,710,263	21,197,666
3.買入選擇權(Bought Options)	3,101,264	4,241,122	3,416,784	2,682,156	2,403,753	2,236,029	2,405,508	4,531,929
4.賣出選擇權(Sold Options)	3,560,093	4,706,572	3,639,758	2,725,273	2,477,204	2,351,801	2,498,448	4,675,708
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	53,123	2,888,987	995,728	539,057	142,557	63,192	74,658	107,072
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	30,542	1,384,916	484,492	227,680	37,204	17,521	1,679	23,423
2.期貨-短部位(Futures -Short Positions)	22,167	1,488,720	494,730	213,583	77,230	39,477	56,946	55,623
3.買入選擇權(Bought Options)	414	7,479	13,691	85,633	16,012	4,727	9,400	13,505
4.賣出選擇權(Sold Options)	0	7,872	2,815	12,161	12,111	1,467	6,633	14,521
二、名目本金餘額	40,531,801	54,684,140	59,679,044	63,474,364	51,244,186	49,047,225	45,912,332	49,276,370
(一)交易目的之契約總額	39,957,903	54,373,244	59,432,285	62,988,300	50,892,485	48,727,264	45,609,068	48,982,277
(二)非交易目的之契約總額	573,898	310,896	246,759	486,064	351,701	319,961	303,264	294,093

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	103年3月底	103年6月底	103年9月底	103年12月底	104年3月底	104年6月底	104年9月底	104年12月底
一、名日本金餘額	58,657,052	54,319,999	56,992,547	55,550,224	56,204,455	55,483,632	58,259,337	55,973,939
(一)店頭市場(OTC)	58,494,028	54,138,736	56,880,331	55,474,326	56,114,764	55,401,379	58,182,328	55,898,779
1. 遠期契約(Forwards)	20,054,564	19,619,585	21,804,807	23,257,108	23,728,200	23,402,516	27,403,538	27,946,184
2. 交換(Swaps)	20,827,448	19,280,565	19,269,959	17,490,551	17,376,365	16,337,052	16,623,926	16,584,172
3. 買入選擇權(Bought Options)	8,669,137	7,506,810	7,799,000	7,264,387	7,428,247	7,744,935	6,979,069	5,610,104
4. 賣出選擇權(Sold Options)	8,942,879	7,731,776	8,006,565	7,462,280	7,581,952	7,916,876	7,175,795	5,758,319
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	163,024	181,263	112,216	75,898	89,691	82,253	77,009	75,160
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	31,171	57,625	21,469	13,685	13,645	6,318	5,789	7,714
2. 期貨-短部位(Futures -Short Positions)	87,453	95,114	43,613	48,061	55,821	60,464	56,453	54,992
3. 買入選擇權(Bought Options)	21,659	15,842	12,614	9,585	13,190	6,671	8,062	6,135
4. 賣出選擇權(Sold Options)	22,741	12,682	34,520	4,567	7,035	8,800	6,705	6,319
二、名日本金餘額	58,657,052	54,319,999	56,992,547	55,550,224	56,204,455	55,483,632	58,259,337	55,973,939
(一)交易目的之契約總額	58,393,011	54,022,604	56,702,815	55,305,713	55,961,195	55,244,318	58,039,348	55,763,571
(二)非交易目的之契約總額	264,041	297,395	289,732	244,511	243,260	239,314	219,989	210,368

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3月底	105年6月底	105年9月底	105年12月底	106年3月底	106年6月底	106年9月底	106年12月底
一、名目本金餘額	54,843,151	53,554,901	50,020,247	49,927,470	49,603,627	48,062,584	49,103,125	47,824,505
(一)店頭市場(OTC)	54,752,913	53,432,516	49,872,711	49,802,395	49,444,971	47,836,643	48,849,373	47,600,716
1.遠期契約(Forwards)	27,810,135	28,425,477	26,802,157	27,899,199	28,678,705	28,661,100	30,281,274	29,312,508
2.交換(Swaps)	17,494,638	17,115,131	16,935,273	17,353,671	17,071,549	16,371,757	16,029,974	16,251,262
3.買入選擇權(Bought Options)	4,640,845	3,827,619	2,957,818	2,174,992	1,697,916	1,246,676	1,089,191	794,559
4.賣出選擇權(Sold Options)	4,807,295	4,064,289	3,177,463	2,374,533	1,996,801	1,557,110	1,448,934	1,242,387
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	90,238	122,385	147,536	125,075	158,656	225,941	253,752	223,789
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	10,965	15,689	23,070	51,798	9,051	83,089	77,609	40,979
2.期貨-短部位(Futures -Short Positions)	60,136	94,603	109,910	60,768	131,545	123,208	152,447	159,337
3.買入選擇權(Bought Options)	6,875	5,513	6,857	6,616	9,147	8,653	13,173	10,842
4.賣出選擇權(Sold Options)	12,262	6,580	7,699	5,893	8,913	10,991	10,523	12,631
二、名目本金餘額	54,843,151	53,554,901	50,020,247	49,927,470	49,603,627	48,062,584	49,103,125	47,824,505
(一)交易目的之契約總額	54,660,459	53,375,316	49,846,744	49,751,534	49,398,668	47,857,567	48,891,107	47,614,912
(二)非交易目的之契約總額	182,692	179,585	173,503	175,936	204,959	205,017	212,018	209,593

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	107年3月底	107年6月底	107年9月底	107年12月底	108年3月底	108年6月底	108年9月底	108年12月底
一、名目本金餘額	51,673,085	58,330,692	58,571,868	59,742,478	60,258,573	60,539,264	60,248,091	58,476,466
(一)店頭市場(OTC)	51,280,269	57,906,658	58,160,748	59,223,412	59,991,942	60,357,419	60,005,509	58,322,872
1.遠期契約(Forwards)	30,899,917	35,685,794	35,723,555	36,292,686	35,819,335	34,908,964	34,411,614	33,164,247
2.交換(Swaps)	17,619,021	19,206,951	19,351,097	20,338,888	21,447,438	22,508,134	22,704,696	22,637,846
3.買入選擇權(Bought Options)	980,174	1,056,701	1,082,449	806,471	908,076	1,124,294	1,140,495	975,327
4.賣出選擇權(Sold Options)	1,781,157	1,957,212	2,003,647	1,785,367	1,817,093	1,816,027	1,748,704	1,545,452
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	392,816	424,034	411,120	519,066	266,631	181,845	242,582	153,594
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	155,463	155,169	195,657	122,447	88,001	79,750	104,591	45,370
2.期貨-短部位(Futures -Short Positions)	215,222	249,898	198,397	381,872	166,612	87,112	115,005	91,064
3.買入選擇權(Bought Options)	10,921	10,285	8,748	4,873	5,007	5,365	10,535	7,422
4.賣出選擇權(Sold Options)	11,210	8,682	8,318	9,874	7,011	9,618	12,451	9,738
二、名目本金餘額	51,673,085	58,330,692	58,571,868	59,742,478	60,258,573	60,539,264	60,248,091	58,476,466
(一)交易目的之契約總額	51,408,152	58,069,439	58,252,350	59,360,883	59,857,443	60,088,544	59,829,604	58,095,418
(二)非交易目的之契約總額	264,933	261,253	319,518	381,595	401,130	450,720	418,487	381,048

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	109年3月底	109年6月底	109年9月底	109年12月底	110年3月底	110年6月底	110年9月底	110年12月底
一、名目本金餘額	61,588,086	59,205,361	57,963,333	54,427,115	56,041,061	55,569,767	57,273,300	58,561,530
(一)店頭市場(OTC)	61,362,196	58,996,197	57,743,843	54,267,963	55,824,026	55,337,230	56,995,271	58,285,126
1. 遠期契約(Forwards)	34,535,846	33,528,396	32,638,608	30,445,559	31,897,504	31,300,490	32,455,022	33,689,812
2. 交換(Swaps)	23,971,920	22,845,849	22,299,651	21,559,436	21,434,394	20,996,806	21,543,106	21,993,761
3. 買入選擇權(Bought Options)	1,228,381	1,155,319	1,245,239	978,197	1,117,910	1,434,808	1,425,725	1,249,868
4. 賣出選擇權(Sold Options)	1,626,049	1,466,633	1,560,345	1,284,771	1,374,218	1,605,126	1,571,418	1,351,685
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	225,890	209,164	219,490	159,152	217,035	232,537	278,029	276,404
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	36,266	25,369	19,534	17,424	29,489	26,039	33,990	19,431
2. 期貨-短部位(Futures -Short Positions)	170,252	173,554	190,228	137,342	182,467	204,747	240,221	254,179
3. 買入選擇權(Bought Options)	7,732	5,496	4,118	2,854	1,877	921	1,667	1,493
4. 賣出選擇權(Sold Options)	11,640	4,745	5,610	1,532	3,202	830	2,151	1,301
二、名目本金餘額	61,588,086	59,205,361	57,963,333	54,427,115	56,041,061	55,569,767	57,273,300	58,561,530
(一)交易目的之契約總額	61,160,602	58,765,715	57,526,839	53,981,672	55,604,465	55,120,463	56,787,538	58,009,239
(二)非交易目的之契約總額	427,484	439,646	436,494	445,443	436,596	449,304	485,762	552,291

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	111年3月底	111年6月底	111年9月底	111年12月底	112年3月底	112年6月底	112年9月底	112年12月底
一、名目本金餘額	65,660,269	69,244,777	76,439,136	70,354,855	72,298,044	72,527,099	74,862,128	74,103,750
(一)店頭市場(OTC)	65,315,939	68,968,201	76,258,595	70,191,602	72,182,807	72,388,254	74,591,953	73,996,288
1.遠期契約(Forwards)	38,010,494	39,547,808	44,516,853	38,906,712	40,277,868	40,413,827	42,695,237	41,447,850
2.交換(Swaps)	24,029,219	25,953,796	27,831,998	28,040,479	28,308,799	28,478,731	28,036,805	28,844,785
3.買入選擇權(Bought Options)	1,585,842	1,702,415	1,903,516	1,568,233	1,719,793	1,673,970	1,848,803	1,784,144
4.賣出選擇權(Sold Options)	1,690,384	1,764,182	2,006,228	1,676,178	1,876,347	1,821,726	2,011,108	1,919,509
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	344,330	276,576	180,541	163,253	115,237	138,845	270,175	107,462
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	38,760	63,907	18,386	49,125	14,525	65,426	83,484	24,711
2.期貨-短部位(Futures -Short Positions)	296,214	211,061	155,724	113,030	99,846	73,100	185,899	82,524
3.買入選擇權(Bought Options)	4,084	633	3,194	257	245	185	365	227
4.賣出選擇權(Sold Options)	5,272	975	3,237	841	621	134	427	-
二、名目本金餘額	65,660,269	69,244,777	76,439,136	70,354,855	72,298,044	72,527,099	74,862,128	74,103,750
(一)交易目的之契約總額	65,124,118	68,673,007	75,818,305	69,653,629	71,666,649	71,934,879	74,276,621	73,266,512
(二)非交易目的之契約總額	536,151	571,770	620,831	701,226	631,395	592,220	585,507	837,238

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	113年3月底	113年6月底	113年9月底	113年12月底	114年3月底	114年6月底	114年9月底	114年12月底
一、名日本金餘額	81,544,711	85,644,559	88,902,921	89,346,937	93,335,487	86,927,886	92,647,086	94,782,932
(一)店頭市場(OTC)	81,239,567	85,453,157	88,748,435	89,085,139	93,177,953	86,772,719	92,476,840	94,634,677
1.遠期契約(Forwards)	45,277,828	46,832,571	45,156,392	43,270,508	44,641,970	37,515,959	40,647,584	39,305,671
2.交換(Swaps)	31,836,252	34,182,566	38,848,175	41,110,479	43,937,430	45,032,402	47,302,889	50,810,905
3.買入選擇權(Bought Options)	1,986,071	2,144,801	2,295,820	2,255,260	2,181,624	2,026,885	2,197,229	2,173,917
4.賣出選擇權(Sold Options)	2,139,416	2,293,219	2,448,048	2,448,892	2,416,929	2,197,473	2,329,138	2,344,184
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	305,144	191,402	154,486	261,798	157,534	155,167	170,246	148,255
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	136,351	96,457	93,742	114,388	52,117	73,334	107,651	78,825
2.期貨-短部位(Futures -Short Positions)	167,898	94,404	58,469	145,139	102,822	79,723	58,174	67,257
3.買入選擇權(Bought Options)	501	239	732	744	966	667	1,170	68
4.賣出選擇權(Sold Options)	394	302	1,543	1,527	1,629	1,443	3,251	2,105
二、名日本金餘額	81,544,711	85,644,559	88,902,921	89,346,937	93,335,487	86,927,886	92,647,086	94,782,932
(一)交易目的之契約總額	80,810,141	84,968,090	88,194,803	88,430,359	92,536,094	86,249,660	91,859,350	93,956,539
(二)非交易目的之契約總額	734,570	676,469	708,118	916,578	799,393	678,226	787,736	826,393

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)。