年月	總交易量	匯率有關契約	利率有關契約	總交易量	匯率有關契約	利率有關契約
90/12	1,235,735	1,149,087	86,103	1,236	1,149	86
91/3	1,577,800	1,311,254	261,223	1,578	1,311	261
91/6	1,910,058	1,669,183	237,751	1,910	1,669	238
91/9	1,642,499	1,325,977	297,295	1,642	1,326	297
91/12	1,683,150	1,495,026	188,124	1,683	1,495	188
92/3	2,181,734	1,693,392	482,424	2,182	1,693	482
92/6	2,431,119	1,980,560	433,023	2,431	1,981	433
92/9	3,340,846	2,872,861	439,052	3,341	2,873	439
92/12	2,581,612	2,293,359	284,503	2,582	2,293	285
93/3	3,980,031	3,365,183	558,424	3,980	3,365	558
93/6	4,245,477	3,434,169	784,338	4,245	3,434	784
93/9	4,083,032	3,252,826	819,943	4,083	3,253	820
93/12	4,626,743	3,924,629	700,770	4,627	3,925	701
94/3	4,965,032	3,760,509	1,150,216	4,965	3,761	1,150
94/6	4,773,622	3,544,338	1,213,345	4,774	3,544	1,213
94/9	4,898,809	3,708,636	1,183,017	4,899	3,709	1,183
94/12	5,773,305	5,006,039	759,679	5,773	5,006	760
95/3	6,350,635	4,892,798	1,441,170	6,351	4,893	1,441
95/6	7,029,569	5,576,623	1,437,864	7,030	5,577	1,438
95/9	7,041,978	5,826,624	1,185,914	7,042	5,827	1,186
95/12	7,208,957	6,304,659	873,851	7,209	6,305	874
96/3	8,841,649	6,423,127	2,386,212	8,842	6,423	2,386
96/6	8,325,877	5,494,503	2,561,059	8,326	5,495	2,561
96/9	7,444,372	5,438,541	1,767,400	7,444	5,439	1,767
96/12	7,194,504	5,497,460	1,439,145	7,195	5,497	1,439
97/3	9,903,783	6,552,712	2,946,655	9,904	6,553	2,947

97/6	9,138,928	5,782,702	2,849,656	9,139	5,783	2,850
97/9	9,743,924	6,731,112	2,559,841	9,744	6,731	2,560
97/12	6,888,624	4,634,432	1,901,783	6,889	4,634	1,902
98/3	9,311,519	5,330,087	3,565,070	9,312	5,330	3,565
98/6	9,563,307	5,706,837	3,522,238	9,563	5,707	3,522
98/9	9,089,255	6,452,391	2,265,033	9,089	6,452	2,265
98/12	8,406,261	6,944,166	1,082,367	8,406	6,944	1,082
99/3	10,509,227	7,729,764	2,317,093	10,509	7,730	2,317
99/6	9,661,154	7,307,550	1,908,646	9,661	7,308	1,909
99/9	10,941,008	8,043,862	2,479,522	10,941	8,044	2,480
99/12	9,848,195	7,887,411	1,528,451	9,848	7,887	1,528
100/3	11,440,124	8,373,552	2,009,930	11,440	8,374	2,010
100/6	11,089,716	8,437,078	2,046,398	11,090	8,437	2,046
100/9	11,574,838	10,107,235	987,897	11,575	10,107	988
100/12	8,968,254	7,979,268	710,861	8,968	7,979	711

附表1　銀行衍生性金融商品餘額季報表

102年3月底

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、名目本金餘額	**21,930,509**	**27,082,587**	**56,185**	**51,457**	**63,519**	**-**	**49,184,257**	**100.00**
(一)店頭市場(OTC)	21,851,530	27,082,587	34,887	51,092	63,519	-	49,083,615	99.80
1.遠期契約(Forwards)	2,957	17,295,655	-	1,332	-	-	17,299,944	35.17
2.交換(Swaps)	21,082,534	2,423,571	16,467	14,224	63,219	-	23,600,015	47.99
3.買入選擇權(Bought Options)	351,336	3,618,725	7,641	17,279	300	-	3,995,281	8.12
4.賣出選擇權(Sold Options)	414,703	3,744,636	10,779	18,257	-	-	4,188,375	8.52
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	78,979	-	21,298	365	-	-	100,642	0.20
1.期貨-長部位(Futures-Long Positions)	12,501	-	63	91	-	-	12,655	0.02
2.期貨-短部位(Futures-Short Positions)	66,478	-	1,860	17	-	-	68,355	0.14
3.買入選擇權(Bought Options)	-	-	10,890	127	-	-	11,017	0.02
4.賣出選擇權(Sold Options)	-	-	8,485	130	-	-	8,615	0.02
二、名目本金餘額	**21,930,509**	**27,082,587**	**56,185**	**51,457**	**63,519**	**-**	**49,184,257**	100.00
(一)交易目的之契約總額	21,646,621	27,055,180	56,185	51,457	63,433	-	48,872,876	99.37
(二)非交易目的之契約總額	283,888	27,407	-	-	86	-	311,381	0.63

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(在台一般分行及國際金融業務分行)。

附表2　銀行衍生性金融商品名目本金餘額季報比較表

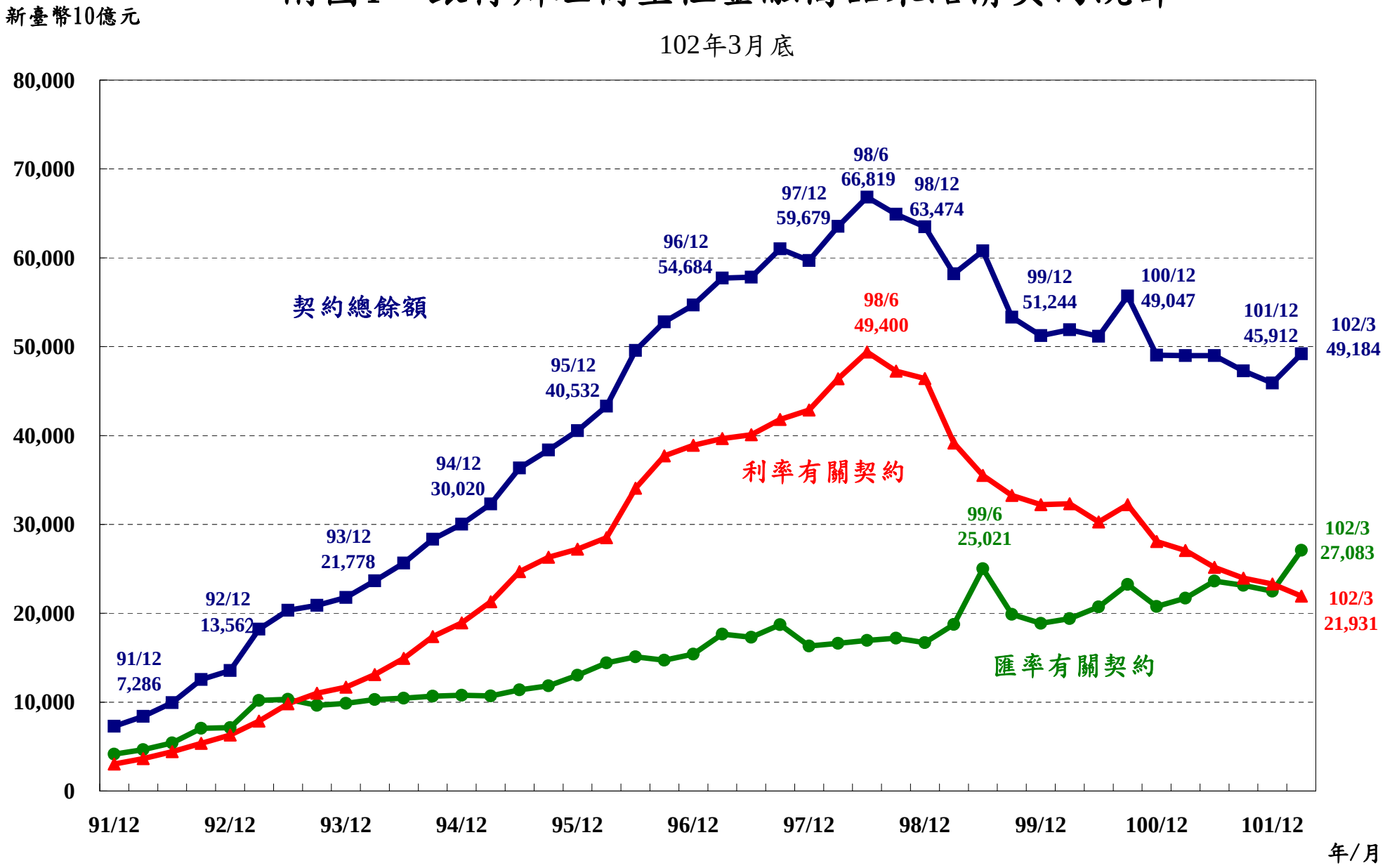
102年3月底

單位：新臺幣百萬元；%

項目	102年3月底		101年12月底		比較增減	
	金額	比重	金額	比重	金額	變動率
一、名目本金餘額	**49,184,257**	**100.00**	**45,912,332**	**100.00**	**3,271,925**	**7.13**
(一)店頭市場(OTC)	49,083,615	99.80	45,837,674	99.84	3,245,941	7.08
1.遠期契約(Forwards)	17,299,944	35.17	16,223,455	35.34	1,076,489	6.64
2.交換(Swaps)	23,600,015	47.99	24,710,263	53.82	-1,110,248	-4.49
3.買入選擇權(Bought Options)	3,995,281	8.12	2,405,508	5.24	1,589,773	66.09
4.賣出選擇權(Sold Options)	4,188,375	8.52	2,498,448	5.44	1,689,927	67.64
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	100,642	0.20	74,658	0.16	25,984	34.80
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	12,655	0.02	1,679	0.00	10,976	653.72
2.期貨-短部位(Futures -Short Positions)	68,355	0.14	56,946	0.12	11,409	20.03
3.買入選擇權(Bought Options)	11,017	0.02	9,400	0.02	1,617	17.20
4.賣出選擇權(Sold Options)	8,615	0.02	6,633	0.02	1,982	29.88
二、名目本金餘額	**49,184,257**	**100.00**	**45,912,332**	**100.00**	**3,271,925**	**7.13**
(一)交易目的之契約總額	48,872,876	99.37	45,609,068	99.34	3,263,808	7.16
(二)非交易目的之契約總額	311,381	0.63	303,264	0.66	8,117	2.68

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)。

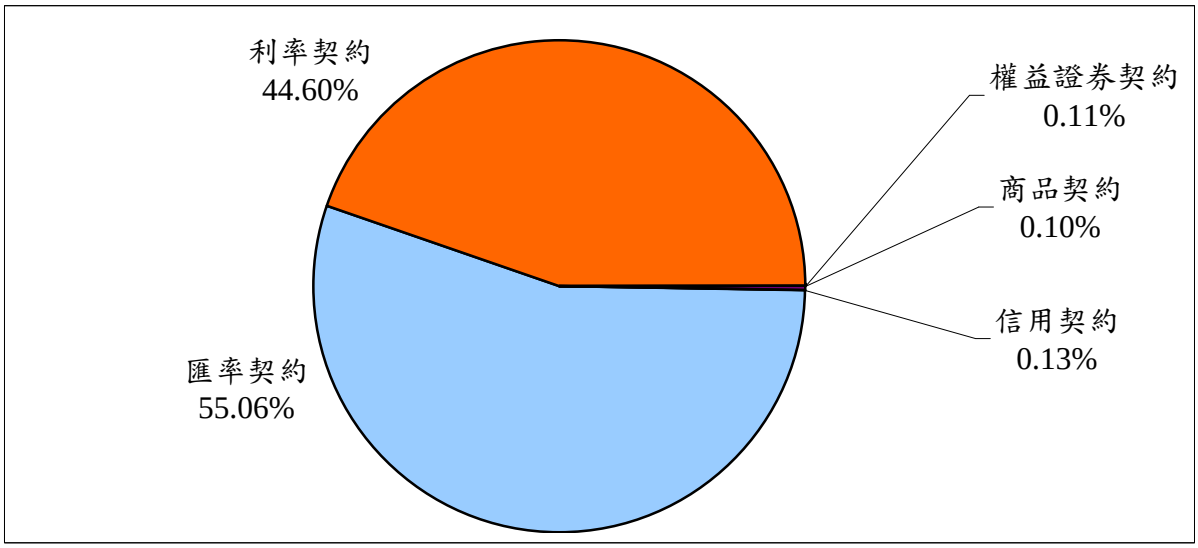
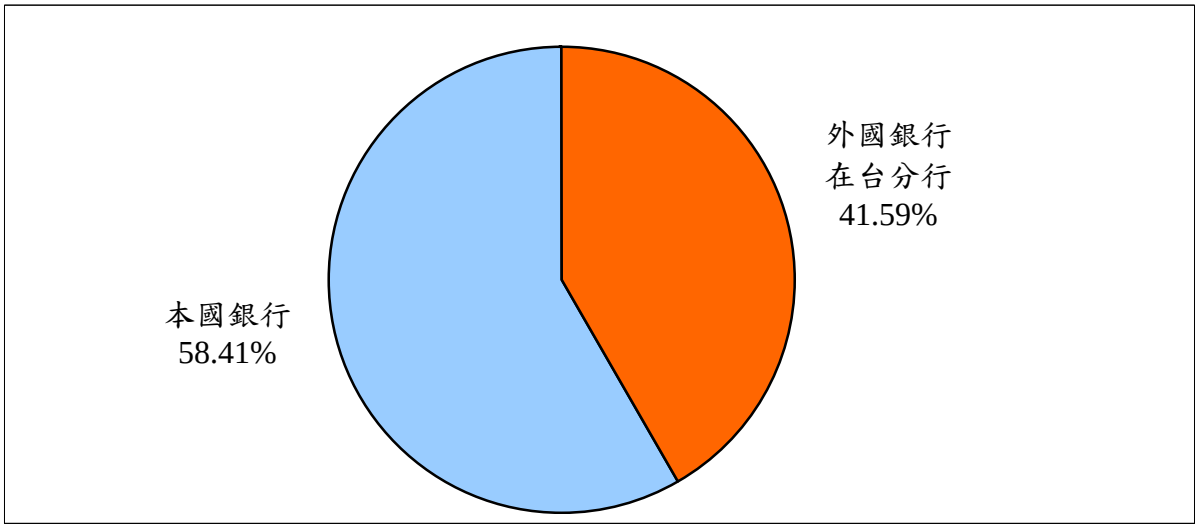
附圖1　銀行辦理衍生性金融商品未結清契約統計



附圖2 銀行衍生性金融商品未結清契約內容分析

102年3月底

風險類別



銀行類別