

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

1

附表1 銀行衍生性金融商品餘額季報表

101年12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	23,288,477	22,475,498	46,503	39,639	62,215	-	45,912,332	100.00
(一)店頭市場(OTC)	23,231,306	22,475,498	29,147	39,508	62,215	-	45,837,674	99.84
1.遠期契約(Forwards)	2,876	16,220,115	-	464	-	-	16,223,455	35.34
2.交換(Swaps)	22,287,357	2,336,834	11,997	13,360	60,715	-	24,710,263	53.82
3.買入選擇權(Bought Options)	444,571	1,940,210	6,720	12,507	1,500	-	2,405,508	5.24
4.賣出選擇權(Sold Options)	496,502	1,978,339	10,430	13,177	-	-	2,498,448	5.44
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	57,171	-	17,356	131	-	-	74,658	0.16
1.期貨-長部位(Futures-Long Positions)	1,075	-	542	62	-	-	1,679	0.00
2.期貨-短部位(Futures-Short Positions)	56,096	-	850	-	-	-	56,946	0.12
3.買入選擇權(Bought Options)	-	-	9,385	15	-	-	9,400	0.02
4.賣出選擇權(Sold Options)	-	-	6,579	54	-	-	6,633	0.02
二、名目本金餘額	23,288,477	22,475,498	46,503	39,639	62,215	-	45,912,332	100.00
(一)交易目的之契約總額	23,013,463	22,447,331	46,503	39,639	62,132	-	45,609,068	99.34
(二)非交易目的之契約總額	275,014	28,167	-	-	83	-	303,264	0.66

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

101年12月底

單位：新臺幣百萬元；%

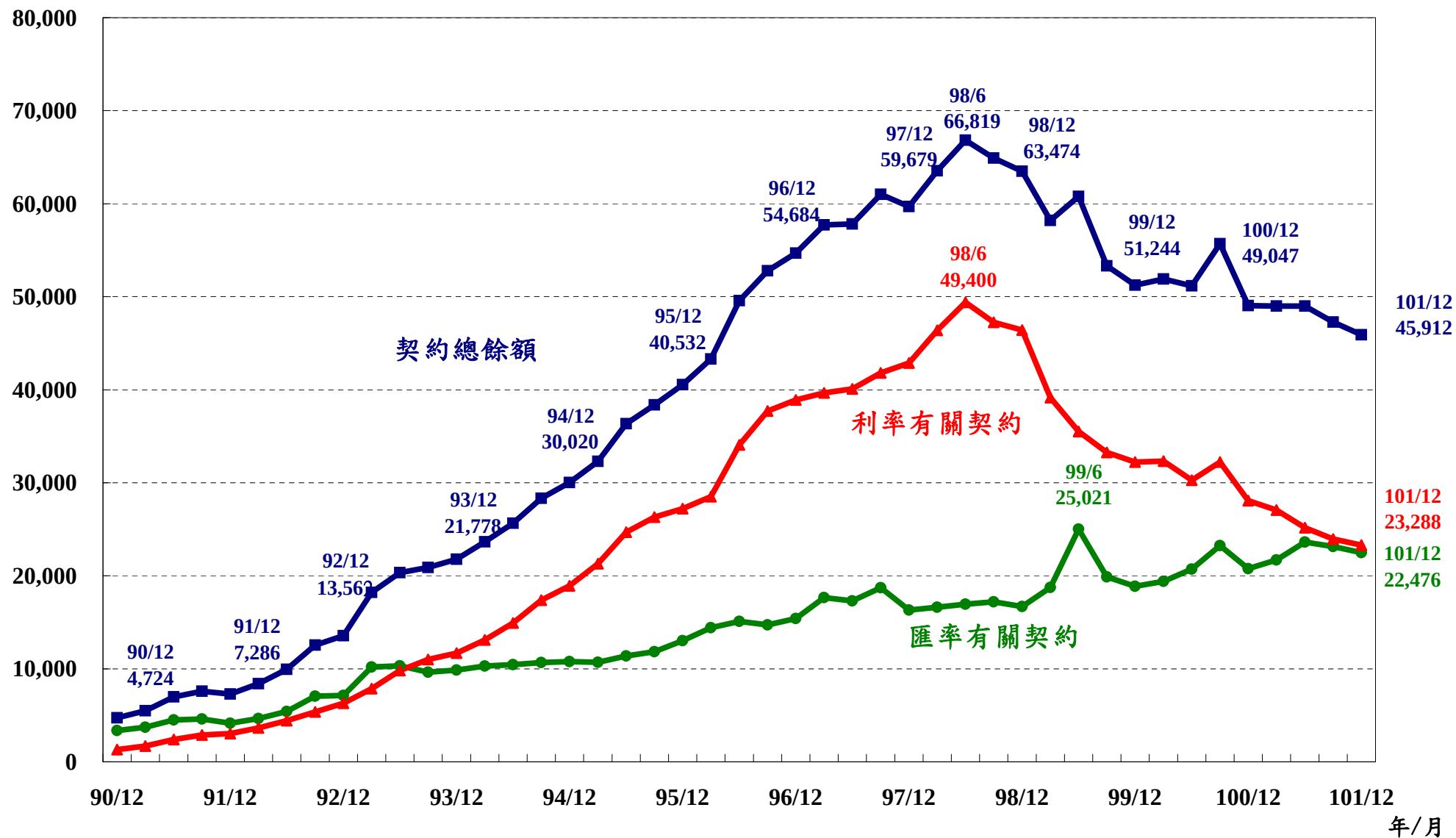
項 目	101年12月底		101年9月底		比 較 增 減	
	金額	比重	金額	比重	金額	變動率
一、名目本金餘額	45,912,332	100.00	47,273,707	100.00	-1,361,375	-2.88
(一)店頭市場(OTC)	45,837,674	99.84	47,224,131	99.89	-1,386,457	-2.94
1.遠期契約(Forwards)	16,223,455	35.34	16,031,111	33.91	192,344	1.20
2.交換(Swaps)	24,710,263	53.82	25,205,389	53.32	-495,126	-1.96
3.買入選擇權(Bought Options)	2,405,508	5.24	2,947,113	6.23	-541,605	-18.38
4.賣出選擇權(Sold Options)	2,498,448	5.44	3,040,518	6.43	-542,070	-17.83
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	74,658	0.16	49,576	0.11	25,082	50.59
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	1,679	0.00	2,681	0.01	-1,002	-37.37
2.期貨-短部位(Futures -Short Positions)	56,946	0.12	35,552	0.08	21,394	60.18
3.買入選擇權(Bought Options)	9,400	0.02	6,221	0.01	3,179	51.10
4.賣出選擇權(Sold Options)	6,633	0.02	5,122	0.01	1,511	29.50
二、名目本金餘額	45,912,332	100.00	47,273,707	100.00	-1,361,375	-2.88
(一)交易目的之契約總額	45,609,068	99.34	46,971,880	99.36	-1,362,812	-2.90
(二)非交易目的之契約總額	303,264	0.66	301,827	0.64	1,437	0.48

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

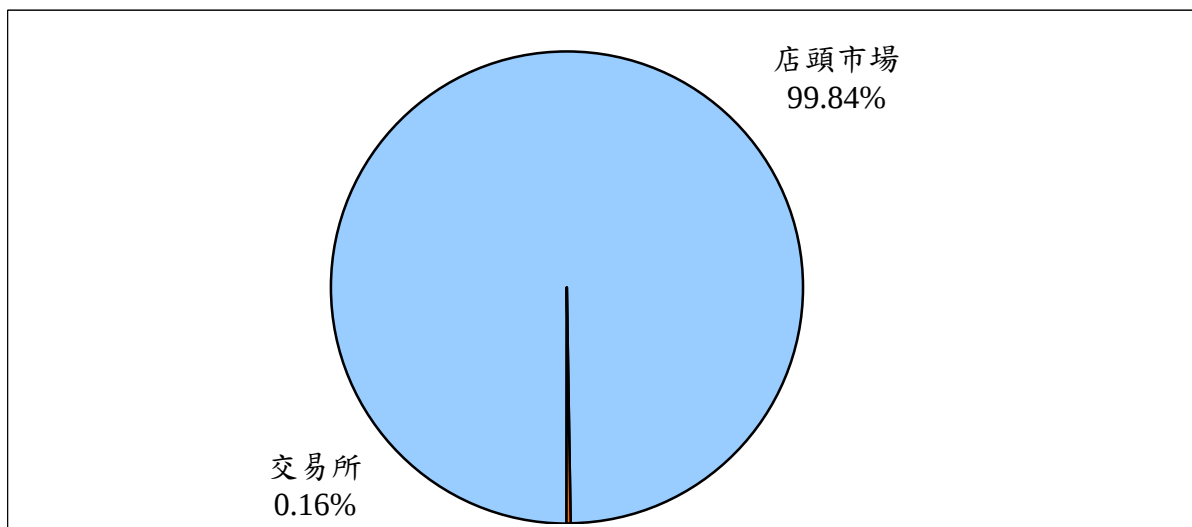
新臺幣10億元

101年12月

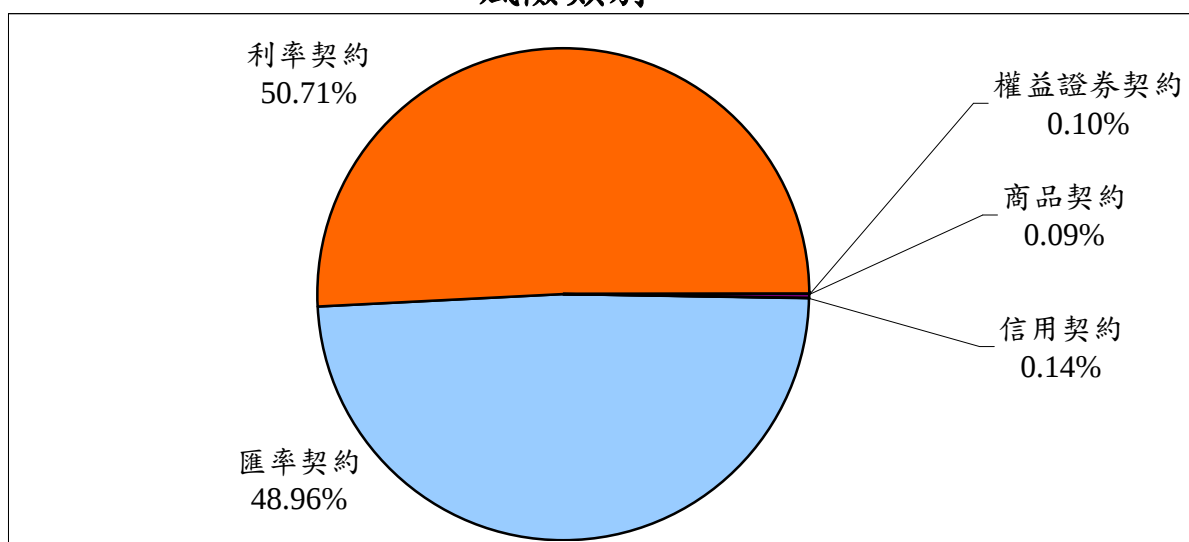


附圖2 銀行衍生性金融商品未結清契約內容分析

101年12月底
市場類別



風險類別



銀行類別

