

銀行衍生性金融商品餘額季報表

98年9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	百分比
一、名目本金餘額	47,252,621	17,210,244	35,220	245,174	137,532	9,933	64,890,724	100.00%
(一)店頭市場(OTC)	46,460,231	17,210,244	17,837	245,007	137,532	9,933	64,080,784	98.75%
1.遠期契約(Forwards)	54,059	10,736,985	-	1,806	-	-	10,792,850	16.63%
2.交換(Swaps)	42,517,575	4,652,123	9,344	12,985	134,218	9,933	47,336,178	72.95%
3.買入選擇權(Bought Options)	1,910,541	908,564	4,636	115,108	3,314	-	2,942,163	4.53%
4.賣出選擇權(Sold Options)	1,978,056	912,572	3,857	115,108	-	-	3,009,593	4.64%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	792,390	-	17,383	167	-	-	809,940	1.25%
1.期貨-長部位(Futures-Long Positions)	359,714	-	3,205	11	-	-	362,930	0.56%
2.期貨-短部位(Futures-Short Positions)	349,891	-	334	-	-	-	350,225	0.54%
3.買入選擇權(Bought Options)	76,637	-	10,321	69	-	-	87,027	0.13%
4.賣出選擇權(Sold Options)	6,148	-	3,523	87	-	-	9,758	0.02%
二、名目本金餘額	47,252,621	17,210,244	35,220	245,174	137,532	9,933	64,890,724	100.00%
(一)交易目的之契約總額	47,058,936	17,188,828	35,220	245,174	137,118	9,933	64,675,209	99.67%
(二)非交易目的之契約總額	193,685	21,416	-	-	414	-	215,515	0.33%

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)。

銀行衍生性金融商品名目本金餘額季報比較表

98年9月底

單位：新臺幣百萬元

項 目	98年9月底		98年6月底		比 較 增 減	
	合計	百分比	合計	百分比	合計	百分比
一、名目本金餘額	64,890,724	100.00%	66,819,124	100.00%	-1,928,400	-2.89%
(一)店頭市場(OTC)	64,080,784	98.75%	66,001,291	98.78%	-1,920,507	-2.91%
1.遠期契約(Forwards)	10,792,850	16.63%	10,961,627	16.41%	-168,777	-1.54%
2.交換(Swaps)	47,336,178	72.95%	48,844,786	73.10%	-1,508,608	-3.09%
3.買入選擇權(Bought Options)	2,942,163	4.53%	3,043,259	4.55%	-101,096	-3.32%
4.賣出選擇權(Sold Options)	3,009,593	4.64%	3,151,619	4.72%	-142,026	-4.51%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	809,940	1.25%	817,833	1.22%	-7,893	-0.97%
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	362,930	0.56%	371,105	0.55%	-8,175	-2.20%
2.期貨-短部位(Futures -Short Positions)	350,225	0.54%	358,489	0.54%	-8,264	-2.31%
3.買入選擇權(Bought Options)	87,027	0.13%	81,729	0.12%	5,298	6.48%
4.賣出選擇權(Sold Options)	9,758	0.02%	6,510	0.01%	3,248	49.89%
二、名目本金餘額	64,890,724	100.00%	66,819,124	100.00%	-1,928,400	-2.89%
(一)交易目的之契約總額	64,675,209	99.67%	66,599,378	99.67%	-1,924,169	-2.89%
(二)非交易目的之契約總額	215,515	0.33%	219,746	0.33%	-4,231	-1.93%

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)。