

銀行衍生性金融商品餘額季報表

100年3月底

單位：新臺幣

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
一、名目本金餘額	32,335,001	19,393,263	54,317	38,686	76,821	-	51,898,088
(一)店頭市場(OTC)	32,275,760	19,393,263	26,647	38,396	76,821	-	51,810,887
1.遠期契約(Forwards)	3,954	12,089,192	-	3,479	-	-	12,096,625
2.交換(Swaps)	29,417,794	5,074,862	5,016	11,024	75,321	-	34,584,017
3.買入選擇權(Bought Options)	1,383,314	1,112,254	4,826	12,123	1,500	-	2,514,017
4.賣出選擇權(Sold Options)	1,470,698	1,116,955	16,805	11,770	-	-	2,616,228
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	59,241	-	27,670	290	-	-	87,201
1.期貨-長部位(Futures-Long Positions)	7,980	-	56	21	-	-	8,057
2.期貨-短部位(Futures-Short Positions)	39,300	-	1,715	80	-	-	41,095
3.買入選擇權(Bought Options)	21	-	15,701	46	-	-	15,768
4.賣出選擇權(Sold Options)	11,940	-	10,198	143	-	-	22,281
二、名目本金餘額	32,335,006	19,393,257	54,319	38,683	76,821	-	51,898,086
(一)交易目的之契約總額	32,029,761	19,321,137	53,170	38,683	76,443	-	51,519,194
(二)非交易目的之契約總額	305,245	72,120	1,149	-	378	-	378,892

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1

百分比
100.00%
99.83%
23.31%
66.64%
4.84%
5.04%
0.17%
0.02%
0.08%
0.03%
0.04%
100.00%
99.27%
0.73%

銀行衍生性金融商品名目本金餘額季報比較表

100年3月底

單位：新臺幣百萬元

項 目	100年3月底		99年12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	51,898,088	100.00%	51,244,186	100.00%	653,902	1.28%
(一)店頭市場(OTC)	51,810,887	99.83%	51,101,629	99.72%	709,258	1.39%
1.遠期契約(Forwards)	12,096,625	23.31%	12,227,032	23.86%	-130,407	-1.07%
2.交換(Swaps)	34,584,017	66.64%	33,993,640	66.34%	590,377	1.74%
3.買入選擇權(Bought Options)	2,514,017	4.84%	2,403,753	4.69%	110,264	4.59%
4.賣出選擇權(Sold Options)	2,616,228	5.04%	2,477,204	4.83%	139,024	5.61%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	87,201	0.17%	142,557	0.28%	-55,356	-38.83%
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	8,057	0.02%	37,204	0.07%	-29,147	-78.34%
2.期貨-短部位(Futures -Short Positions)	41,095	0.08%	77,230	0.15%	-36,135	-46.79%
3.買入選擇權(Bought Options)	15,768	0.03%	16,012	0.03%	-244	-1.52%
4.賣出選擇權(Sold Options)	22,281	0.04%	12,111	0.03%	10,170	83.97%
二、名目本金餘額	51,898,086	100.00%	51,244,186	100.00%	653,900	1.28%
(一)交易目的之契約總額	51,519,194	99.27%	50,892,485	99.31%	626,709	1.23%
(二)非交易目的之契約總額	378,892	0.73%	351,701	0.69%	27,191	7.73%

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)。