

銀行衍生性金融商品餘額季報表

98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	百分比
一、名目本金餘額	46,388,284	16,627,868	33,904	314,585	158,396	10,201	63,533,238	100.00%
(一)店頭市場(OTC)	45,519,643	16,627,868	24,698	314,124	158,396	10,201	62,654,930	98.62%
1.遠期契約(Forwards)	59,188	9,886,693	-	3,520	-	-	9,949,401	15.66%
2.交換(Swaps)	40,385,252	5,492,682	12,295	4,126	154,496	10,201	46,059,052	72.50%
3.買入選擇權(Bought Options)	2,457,983	625,674	6,557	153,239	3,900	-	3,247,353	5.11%
4.賣出選擇權(Sold Options)	2,617,220	622,819	5,846	153,239	-	-	3,399,124	5.35%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	868,641	-	9,206	461	-	-	878,308	1.38%
1.期貨-長部位(Futures-Long Positions)	402,891	-	313	183	-	-	403,387	0.63%
2.期貨-短部位(Futures-Short Positions)	388,497	-	288	-	-	-	388,785	0.61%
3.買入選擇權(Bought Options)	77,253	-	5,538	76	-	-	82,867	0.13%
4.賣出選擇權(Sold Options)	-	-	3,067	202	-	-	3,269	0.01%
二、名目本金餘額	46,388,284	16,627,868	33,904	314,585	158,396	10,201	63,533,238	100.00%
(一)交易目的之契約總額	46,166,269	16,615,609	33,904	314,585	157,960	10,201	63,298,528	99.63%
(二)非交易目的之契約總額	222,015	12,259	-	-	436	-	234,710	0.37%

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3月底

單位：新臺幣百萬元

項 目	98年3月底		97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	63,533,238	100.00%	59,679,044	100.00%	3,854,194	6.46%
(一)店頭市場(OTC)	62,654,930	98.62%	58,683,316	98.34%	3,971,614	6.77%
1.遠期契約(Forwards)	9,949,401	15.66%	9,752,834	16.34%	196,567	2.02%
2.交換(Swaps)	46,059,052	72.50%	41,873,940	70.17%	4,185,112	9.99%
3.買入選擇權(Bought Options)	3,247,353	5.11%	3,416,784	5.73%	-169,431	-4.96%
4.賣出選擇權(Sold Options)	3,399,124	5.35%	3,639,758	6.10%	-240,634	-6.61%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	878,308	1.38%	995,728	1.66%	-117,420	-11.79%
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	403,387	0.63%	484,492	0.81%	-81,105	-16.74%
2.期貨-短部位(Futures -Short Positions)	388,785	0.61%	494,730	0.83%	-105,945	-21.41%
3.買入選擇權(Bought Options)	82,867	0.13%	13,691	0.02%	69,176	505.27%
4.賣出選擇權(Sold Options)	3,269	0.01%	2,815	0.00%	454	16.13%
二、名目本金餘額	63,533,238	100.00%	59,679,044	100.00%	3,854,194	6.46%
(一)交易目的之契約總額	63,298,528	99.63%	59,432,285	99.59%	3,866,243	6.51%
(二)非交易目的之契約總額	234,710	0.37%	246,759	0.41%	-12,049	-4.88%

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)。