

銀行衍生性金融商品餘額季報表

98年6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	49,400,280	16,947,608	32,042	288,682	140,480	10,032	66,819,124
(一)店頭市場(OTC)	48,592,895	16,947,608	21,688	288,588	140,480	10,032	66,001,291
1.遠期契約(Forwards)	73,114	10,886,059	-	2,454	-	-	10,961,627
2.交換(Swaps)	44,269,480	4,402,149	9,915	15,630	137,580	10,032	48,844,786
3.買入選擇權(Bought Options)	2,075,841	823,050	6,216	135,252	2,900	-	3,043,259
4.賣出選擇權(Sold Options)	2,174,460	836,350	5,557	135,252	-	-	3,151,619
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	807,385	-	10,354	94	-	-	817,833
1.期貨-長部位(Futures-Long Positions)	371,100	-	-	5	-	-	371,105
2.期貨-短部位(Futures-Short Positions)	358,242	-	247	-	-	-	358,489
3.買入選擇權(Bought Options)	74,804	-	6,859	66	-	-	81,729
4.賣出選擇權(Sold Options)	3,239	-	3,248	23	-	-	6,510
二、名目本金餘額	49,400,280	16,947,608	32,042	288,682	140,480	10,032	66,819,124
(一)交易目的之契約總額	49,197,477	16,931,087	32,042	288,682	140,058	10,032	66,599,378
(二)非交易目的之契約總額	202,803	16,521	-	-	422	-	219,746

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

百萬元

百分比
100.00%
98.78%
16.41%
73.10%
4.55%
4.72%
1.22%
0.55%
0.54%
0.12%
0.01%
100.00%
99.67%
0.33%

銀行衍生性金融商品名目本金餘額季報比較表

98年6月底

單位：新臺幣百萬元

項 目	98年6月底		98年3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	66,819,124	100.00%	63,533,238	100.00%	3,285,886	5.17%
(一)店頭市場(OTC)	66,001,291	98.78%	62,654,930	98.62%	3,346,361	5.34%
1.遠期契約(Forwards)	10,961,627	16.41%	9,949,401	15.66%	1,012,226	10.17%
2.交換(Swaps)	48,844,786	73.10%	46,059,052	72.50%	2,785,734	6.05%
3.買入選擇權(Bought Options)	3,043,259	4.55%	3,247,353	5.11%	-204,094	-6.28%
4.賣出選擇權(Sold Options)	3,151,619	4.72%	3,399,124	5.35%	-247,505	-7.28%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	817,833	1.22%	878,308	1.38%	-60,475	-6.89%
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	371,105	0.55%	403,387	0.63%	-32,282	-8.00%
2.期貨-短部位(Futures -Short Positions)	358,489	0.54%	388,785	0.61%	-30,296	-7.79%
3.買入選擇權(Bought Options)	81,729	0.12%	82,867	0.13%	-1,138	-1.37%
4.賣出選擇權(Sold Options)	6,510	0.01%	3,269	0.01%	3,241	99.14%
二、名目本金餘額	66,819,124	100.00%	63,533,238	100.00%	3,285,886	5.17%
(一)交易目的之契約總額	66,599,378	99.67%	63,298,528	99.63%	3,300,850	5.21%
(二)非交易目的之契約總額	219,746	0.33%	234,710	0.37%	-14,964	-6.38%

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)。