

銀行衍生性金融商品餘額季報表

99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	35,507,979	25,021,464	33,677	114,389	99,647	12,900	60,790,056
(一)店頭市場(OTC)	35,048,246	25,021,464	17,271	114,163	99,647	12,900	60,313,691
1.遠期契約(Forwards)	22,701	13,381,261	-	4,129	-	-	13,408,091
2.交換(Swaps)	31,462,399	9,695,570	7,091	7,964	97,247	-	41,270,271
3.買入選擇權(Bought Options)	1,859,639	958,801	5,498	51,124	2,400	12,900	2,890,362
4.賣出選擇權(Sold Options)	1,703,507	985,832	4,682	50,946	-	-	2,744,967
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	459,733	-	16,406	226	-	-	476,365
1.期貨-長部位(Futures-Long Positions)	136,038	-	203	189	-	-	136,430
2.期貨-短部位(Futures-Short Positions)	139,523	-	1,173	-	-	-	140,696
3.買入選擇權(Bought Options)	183,972	-	7,793	7	-	-	191,772
4.賣出選擇權(Sold Options)	200	-	7,237	30	-	-	7,467
二、名目本金餘額	35,507,979	25,021,464	33,677	114,389	99,647	12,900	60,790,056
(一)交易目的之契約總額	35,246,576	24,965,786	33,645	114,389	99,232	12,900	60,472,528
(二)非交易目的之契約總額	261,403	55,678	32	-	415	-	317,528

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%
99.22%
22.06%
67.89%
4.75%
4.52%
0.78%
0.22%
0.23%
0.32%
0.01%
100.00%
99.48%
0.52%

銀行衍生性金融商品名目本金餘額季報比較表

99年6月底

單位：新臺幣百萬元

項 目	99年6月底		99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	60,790,056	100.00%	58,202,083	100.00%	2,587,973	4.45%
(一)店頭市場(OTC)	60,313,691	99.22%	57,715,723	99.16%	2,597,968	4.50%
1.遠期契約(Forwards)	13,408,091	22.06%	11,796,163	20.27%	1,611,928	13.66%
2.交換(Swaps)	41,270,271	67.89%	39,924,143	68.59%	1,346,128	3.37%
3.買入選擇權(Bought Options)	2,890,362	4.75%	2,993,908	5.14%	-103,546	-3.46%
4.賣出選擇權(Sold Options)	2,744,967	4.52%	3,001,509	5.16%	-256,542	-8.55%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	476,365	0.78%	486,360	0.84%	-9,995	-2.06%
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	136,430	0.22%	182,740	0.31%	-46,310	-25.34%
2.期貨-短部位(Futures -Short Positions)	140,696	0.23%	206,566	0.36%	-65,870	-31.89%
3.買入選擇權(Bought Options)	191,772	0.32%	86,663	0.15%	105,109	121.28%
4.賣出選擇權(Sold Options)	7,467	0.01%	10,391	0.02%	-2,924	-28.14%
二、名目本金餘額	60,790,056	100.00%	58,202,083	100.00%	2,587,973	4.45%
(一)交易目的之契約總額	60,472,528	99.48%	57,943,939	99.56%	2,528,589	4.36%
(二)非交易目的之契約總額	317,528	0.52%	258,144	0.44%	59,384	23.00%

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)。