

銀行衍生性金融商品餘額季報表

100年9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	32,213,880	23,241,022	31,930	105,252	99,169	-	55,691,253
(一)店頭市場(OTC)	32,148,334	23,241,022	21,357	104,657	99,169	-	55,614,539
1. 遠期契約(Forwards)	19,987	14,570,414	14	1,978	-	-	14,592,393
2. 交換(Swaps)	29,746,965	5,588,891	5,567	13,814	97,669	-	35,452,906
3. 買入選擇權(Bought Options)	1,157,136	1,526,501	4,526	44,272	1,500	-	2,733,935
4. 賣出選擇權(Sold Options)	1,224,246	1,555,216	11,250	44,593	-	-	2,835,305
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	65,546	-	10,573	595	-	-	76,714
1. 期貨-長部位(Futures-Long Positions)	10,728	-	153	-	-	-	10,881
2. 期貨-短部位(Futures-Short Positions)	46,874	-	998	348	-	-	48,220
3. 買入選擇權(Bought Options)	-	-	5,421	72	-	-	5,493
4. 賣出選擇權(Sold Options)	7,944	-	4,001	175	-	-	12,120
二、名目本金餘額	32,213,880	23,241,022	31,930	105,252	99,169	-	55,691,253
(一)交易目的之契約總額	31,935,076	23,197,012	31,930	105,252	98,776	-	55,368,046
(二)非交易目的之契約總額	278,804	44,010	-	-	393	-	323,207

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%
99.86%
26.20%
63.66%
4.91%
5.09%
0.14%
0.02%
0.09%
0.01%
0.02%
100.00%
99.42%
0.58%

銀行衍生性金融商品名目本金餘額季報比較表

100年9月底

單位：新臺幣百萬元

項 目	100年9月底		100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	55,691,253	100.00%	51,154,079	100.00%	4,537,174	8.87%
(一)店頭市場(OTC)	55,614,539	99.86%	51,002,516	99.70%	4,612,023	9.04%
1.遠期契約(Forwards)	14,592,393	26.20%	13,019,791	25.45%	1,572,602	12.08%
2.交換(Swaps)	35,452,906	63.66%	32,757,252	64.04%	2,695,654	8.23%
3.買入選擇權(Bought Options)	2,733,935	4.91%	2,574,209	5.03%	159,726	6.20%
4.賣出選擇權(Sold Options)	2,835,305	5.09%	2,651,264	5.18%	184,041	6.94%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	76,714	0.14%	151,563	0.30%	-74,849	-49.38%
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	10,881	0.02%	9,304	0.02%	1,577	16.95%
2.期貨-短部位(Futures -Short Positions)	48,220	0.09%	99,202	0.19%	-50,982	-51.39%
3.買入選擇權(Bought Options)	5,493	0.01%	19,956	0.04%	-14,463	-72.47%
4.賣出選擇權(Sold Options)	12,120	0.02%	23,101	0.05%	-10,981	-47.53%
二、名目本金餘額	55,691,253	100.00%	51,154,079	100.00%	4,537,174	8.87%
(一)交易目的之契約總額	55,368,046	99.42%	50,792,265	99.29%	4,575,781	9.01%
(二)非交易目的之契約總額	323,207	0.58%	361,814	0.71%	-38,607	-10.67%

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)。