

銀行衍生性金融商品餘額季報表

99年12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	32,217,316	18,873,207	44,830	32,199	76,634	-	51,244,186
(一)店頭市場(OTC)	32,100,901	18,873,207	19,365	31,522	76,634	-	51,101,629
1.遠期契約(Forwards)	10,013	12,212,826	-	4,193	-	-	12,227,032
2.交換(Swaps)	29,055,258	4,854,871	5,099	4,178	74,234	-	33,993,640
3.買入選擇權(Bought Options)	1,484,955	902,265	2,338	11,795	2,400	-	2,403,753
4.賣出選擇權(Sold Options)	1,550,675	903,245	11,928	11,356	-	-	2,477,204
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	116,415	-	25,465	677	-	-	142,557
1.期貨-長部位(Futures-Long Positions)	34,837	-	1,741	626	-	-	37,204
2.期貨-短部位(Futures-Short Positions)	77,010	-	220	-	-	-	77,230
3.買入選擇權(Bought Options)	-	-	15,974	38	-	-	16,012
4.賣出選擇權(Sold Options)	4,568	-	7,530	13	-	-	12,111
二、名目本金餘額	32,217,316	18,873,207	44,830	32,199	76,634	-	51,244,186
(一)交易目的之契約總額	31,930,499	18,810,484	43,060	32,199	76,243	-	50,892,485
(二)非交易目的之契約總額	286,817	62,723	1,770	-	391	-	351,701

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%
99.72%
23.86%
66.34%
4.69%
4.83%
0.28%
0.07%
0.15%
0.03%
0.03%
100.00%
99.31%
0.69%

銀行衍生性金融商品名目本金餘額季報比較表

99年12月底

單位：新臺幣百萬元

項 目	99年12月底		99年9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	51,244,186	100.00%	53,319,060	100.00%	-2,074,874	-3.89%
(一)店頭市場(OTC)	51,101,629	99.72%	52,960,191	99.33%	-1,858,562	-3.51%
1.遠期契約(Forwards)	12,227,032	23.86%	12,931,057	24.25%	-704,025	-5.44%
2.交換(Swaps)	33,993,640	66.34%	34,440,334	64.59%	-446,694	-1.30%
3.買入選擇權(Bought Options)	2,403,753	4.69%	2,830,474	5.31%	-426,721	-15.08%
4.賣出選擇權(Sold Options)	2,477,204	4.83%	2,758,326	5.18%	-281,122	-10.19%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	142,557	0.28%	358,869	0.67%	-216,312	-60.28%
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	37,204	0.07%	142,455	0.27%	-105,251	-73.88%
2.期貨-短部位(Futures -Short Positions)	77,230	0.15%	140,874	0.26%	-63,644	-45.18%
3.買入選擇權(Bought Options)	16,012	0.03%	68,891	0.13%	-52,879	-76.76%
4.賣出選擇權(Sold Options)	12,111	0.03%	6,649	0.01%	5,462	82.15%
二、名目本金餘額	51,244,186	100.00%	53,319,060	100.00%	-2,074,874	-3.89%
(一)交易目的之契約總額	50,892,485	99.31%	52,968,581	99.34%	-2,076,096	-3.92%
(二)非交易目的之契約總額	351,701	0.69%	350,479	0.66%	1,222	0.35%

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)。