

銀行衍生性金融商品餘額季報表

98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	46,406,686	16,683,876	53,622	191,518	128,737	9,925	63,474,364
(一)店頭市場(OTC)	45,905,125	16,683,876	16,466	191,178	128,737	9,925	62,935,307
1.遠期契約(Forwards)	22,177	10,415,944	-	2,853	-	-	10,440,974
2.交換(Swaps)	42,133,750	4,800,516	8,480	8,396	125,837	9,925	47,086,904
3.買入選擇權(Bought Options)	1,860,209	724,717	4,310	90,020	2,900	-	2,682,156
4.賣出選擇權(Sold Options)	1,888,989	742,699	3,676	89,909	-	-	2,725,273
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	501,561	-	37,156	340	-	-	539,057
1.期貨-長部位(Futures-Long Positions)	222,522	-	4,869	289	-	-	227,680
2.期貨-短部位(Futures-Short Positions)	213,534	-	49	-	-	-	213,583
3.買入選擇權(Bought Options)	65,505	-	20,123	5	-	-	85,633
4.賣出選擇權(Sold Options)	-	-	12,115	46	-	-	12,161
二、名目本金餘額	46,406,686	16,683,876	53,622	191,518	128,737	9,925	63,474,364
(一)交易目的之契約總額	46,200,070	16,404,840	53,622	191,518	128,325	9,925	62,988,300
(二)非交易目的之契約總額	206,616	279,036	-	-	412	-	486,064

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%
99.15%
16.45%
74.18%
4.23%
4.29%
0.85%
0.36%
0.34%
0.13%
0.02%
100.00%
99.23%
0.77%

銀行衍生性金融商品名目本金餘額季報比較表

98年12月底

單位：新臺幣百萬元

項 目	98年12月底		98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	63,474,364	100.00%	64,890,724	100.00%	-1,416,360	-2.18%
(一)店頭市場(OTC)	62,935,307	99.15%	64,080,784	98.75%	-1,145,477	-1.79%
1.遠期契約(Forwards)	10,440,974	16.45%	10,792,850	16.63%	-351,876	-3.26%
2.交換(Swaps)	47,086,904	74.18%	47,336,178	72.95%	-249,274	-0.53%
3.買入選擇權(Bought Options)	2,682,156	4.23%	2,942,163	4.53%	-260,007	-8.84%
4.賣出選擇權(Sold Options)	2,725,273	4.29%	3,009,593	4.64%	-284,320	-9.45%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	539,057	0.85%	809,940	1.25%	-270,883	-33.44%
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	227,680	0.36%	362,930	0.56%	-135,250	-37.27%
2.期貨-短部位(Futures -Short Positions)	213,583	0.34%	350,225	0.54%	-136,642	-39.02%
3.買入選擇權(Bought Options)	85,633	0.13%	87,027	0.13%	-1,394	-1.60%
4.賣出選擇權(Sold Options)	12,161	0.02%	9,758	0.02%	2,403	24.63%
二、名目本金餘額	63,474,364	100.00%	64,890,724	100.00%	-1,416,360	-2.18%
(一)交易目的之契約總額	62,988,300	99.23%	64,675,209	99.67%	-1,686,909	-2.61%
(二)非交易目的之契約總額	486,064	0.77%	215,515	0.33%	270,549	125.54%

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)。