

銀行衍生性金融商品餘額季報表

100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	30,263,746	20,702,843	53,111	66,830	67,549	-	51,154,079
(一)店頭市場(OTC)	30,144,554	20,702,843	21,011	66,559	67,549	-	51,002,516
1.遠期契約(Forwards)	12,321	13,005,433	101	1,936	-	-	13,019,791
2.交換(Swaps)	27,732,302	4,941,868	4,558	12,475	66,049	-	32,757,252
3.買入選擇權(Bought Options)	1,167,435	1,373,952	5,147	26,175	1,500	-	2,574,209
4.賣出選擇權(Sold Options)	1,232,496	1,381,590	11,205	25,973	-	-	2,651,264
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	119,192	-	32,100	271	-	-	151,563
1.期貨-長部位(Futures-Long Positions)	9,061	-	1	242	-	-	9,304
2.期貨-短部位(Futures-Short Positions)	98,588	-	614	-	-	-	99,202
3.買入選擇權(Bought Options)	225	-	19,717	14	-	-	19,956
4.賣出選擇權(Sold Options)	11,318	-	11,768	15	-	-	23,101
二、名目本金餘額	30,263,746	20,702,843	53,111	66,830	67,549	-	51,154,079
(一)交易目的之契約總額	29,977,240	20,627,906	53,111	66,830	67,178	-	50,792,265
(二)非交易目的之契約總額	286,506	74,937	-	-	371	-	361,814

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%
99.70%
25.45%
64.04%
5.03%
5.18%
0.30%
0.02%
0.19%
0.04%
0.05%
100.00%
99.29%
0.71%

銀行衍生性金融商品名目本金餘額季報比較表

100年6月底

單位：新臺幣百萬元

項 目	100年6月底		100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	51,154,079	100.00%	51,898,088	100.00%	-744,009	-1.43%
(一)店頭市場(OTC)	51,002,516	99.70%	51,810,887	99.83%	-808,371	-1.56%
1.遠期契約(Forwards)	13,019,791	25.45%	12,096,625	23.31%	923,166	7.63%
2.交換(Swaps)	32,757,252	64.04%	34,584,017	66.64%	-1,826,765	-5.28%
3.買入選擇權(Bought Options)	2,574,209	5.03%	2,514,017	4.84%	60,192	2.39%
4.賣出選擇權(Sold Options)	2,651,264	5.18%	2,616,228	5.04%	35,036	1.34%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	151,563	0.30%	87,201	0.17%	64,362	73.81%
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	9,304	0.02%	8,057	0.02%	1,247	15.48%
2.期貨-短部位(Futures -Short Positions)	99,202	0.19%	41,095	0.08%	58,107	141.40%
3.買入選擇權(Bought Options)	19,956	0.04%	15,768	0.03%	4,188	26.56%
4.賣出選擇權(Sold Options)	23,101	0.05%	22,281	0.04%	820	3.68%
二、名目本金餘額	51,154,079	100.00%	51,898,088	100.00%	-744,009	-1.43%
(一)交易目的之契約總額	50,792,265	99.29%	51,519,196	99.27%	-726,931	-1.41%
(二)非交易目的之契約總額	361,814	0.71%	378,892	0.73%	-17,078	-4.51%

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)。