

銀行衍生性金融商品餘額季報表

99年9月底

單位：新臺幣百萬元

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	百分比
一、名目本金餘額	33,255,548	19,875,011	30,589	72,899	85,013	-	53,319,060	100.00%
(一)店頭市場(OTC)	32,912,040	19,875,011	15,926	72,201	85,013	-	52,960,191	99.33%
1.遠期契約(Forwards)	24,801	12,901,730	-	4,526	-	-	12,931,057	24.25%
2.交換(Swaps)	29,576,222	4,770,925	5,570	5,004	82,613	-	34,440,334	64.59%
3.買入選擇權(Bought Options)	1,695,857	1,096,986	3,465	31,766	2,400	-	2,830,474	5.31%
4.賣出選擇權(Sold Options)	1,615,160	1,105,370	6,891	30,905	-	-	2,758,326	5.18%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	343,508	-	14,663	698	-	-	358,869	0.67%
1.期貨-長部位(Futures-Long Positions)	140,165	-	1,783	507	-	-	142,455	0.27%
2.期貨-短部位(Futures-Short Positions)	140,693	-	181	-	-	-	140,874	0.26%
3.買入選擇權(Bought Options)	62,650	-	6,170	71	-	-	68,891	0.13%
4.賣出選擇權(Sold Options)	-	-	6,529	120	-	-	6,649	0.01%
二、名目本金餘額	33,255,548	19,875,011	30,589	72,899	85,013	-	53,319,060	100.00%
(一)交易目的之契約總額	32,965,840	19,816,829	28,403	72,899	84,610	-	52,968,581	99.34%
(二)非交易目的之契約總額	289,708	58,182	2,186	-	403	-	350,479	0.66%

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)。

銀行衍生性金融商品名目本金餘額季報比較表

99年9月底

單位：新臺幣百萬元

項 目	99年9月底		99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	53,319,060	100.00%	55,871,874	100.00%	-2,552,814	-4.57%
(一)店頭市場(OTC)	52,960,191	99.33%	55,514,933	99.36%	-2,554,742	-4.60%
1.遠期契約(Forwards)	12,931,057	24.25%	13,408,091	24.00%	-477,034	-3.56%
2.交換(Swaps)	34,440,334	64.59%	36,471,513 ^R	65.28%	-2,031,179	-5.57%
3.買入選擇權(Bought Options)	2,830,474	5.31%	2,890,362	5.17%	-59,888	-2.07%
4.賣出選擇權(Sold Options)	2,758,326	5.18%	2,744,967	4.91%	13,359	0.49%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	358,869	0.67%	356,941	0.64%	1,928	0.54%
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	142,455	0.27%	136,430	0.25%	6,025	4.42%
2.期貨-短部位(Futures -Short Positions)	140,874	0.26%	140,696	0.25%	178	0.13%
3.買入選擇權(Bought Options)	68,891	0.13%	72,348 ^R	0.13%	-3,457	-4.78%
4.賣出選擇權(Sold Options)	6,649	0.01%	7,467	0.01%	-818	-10.95%
二、名目本金餘額	53,319,060	100.00%	55,871,874	100.00%	-2,552,814	-4.57%
(一)交易目的之契約總額	52,968,581	99.34%	55,554,346	99.43%	-2,585,765	-4.65%
(二)非交易目的之契約總額	350,479	0.66%	317,528	0.57%	32,951	10.38%

註1：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)。

註2：R係修正數字。