

銀行衍生性金融商品餘額季報表

99年3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	39,140,298	18,736,920	49,170	142,308	123,507	9,880	58,202,083	100.00%
(一)店頭市場(OTC)	38,688,808	18,736,920	14,523	142,085	123,507	9,880	57,715,723	99.16%
1.遠期契約(Forwards)	32,175	11,761,115	-	2,873	-	-	11,796,163	20.27%
2.交換(Swaps)	34,867,257	4,911,634	7,045	7,220	121,107	9,880	39,924,143	68.59%
3.買入選擇權(Bought Options)	1,900,588	1,021,033	3,891	65,996	2,400	-	2,993,908	5.14%
4.賣出選擇權(Sold Options)	1,888,788	1,043,138	3,587	65,996	-	-	3,001,509	5.16%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	451,490	-	34,647	223	-	-	486,360	0.84%
1.期貨-長部位(Futures-Long Positions)	180,502	-	2,137	101	-	-	182,740	0.31%
2.期貨-短部位(Futures-Short Positions)	206,404	-	162	-	-	-	206,566	0.36%
3.買入選擇權(Bought Options)	64,584	-	21,999	80	-	-	86,663	0.15%
4.賣出選擇權(Sold Options)	-	-	10,349	42	-	-	10,391	0.02%
二、名目本金餘額	39,140,298	18,736,920	49,170	142,308	123,507	9,880	58,202,083	100.00%
(一)交易目的之契約總額	38,920,000	18,699,483	49,170	142,308	123,098	9,880	57,943,939	99.56%
(二)非交易目的之契約總額	220,298	37,437	-	-	409	-	258,144	0.44%

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3月底

單位：新臺幣百萬元

項 目	99年3月底		98年12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	58,202,083	100.00%	63,474,364	100.00%	-5,272,281	-8.31%
(一)店頭市場(OTC)	57,715,723	99.16%	62,935,307	99.15%	-5,219,584	-8.29%
1.遠期契約(Forwards)	11,796,163	20.27%	10,440,974	16.45%	1,355,189	12.98%
2.交換(Swaps)	39,924,143	68.59%	47,086,904	74.18%	-7,162,761	-15.21%
3.買入選擇權(Bought Options)	2,993,908	5.14%	2,682,156	4.23%	311,752	11.62%
4.賣出選擇權(Sold Options)	3,001,509	5.16%	2,725,273	4.29%	276,236	10.14%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	486,360	0.84%	539,057	0.85%	-52,697	-9.78%
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	182,740	0.31%	227,680	0.36%	-44,940	-19.74%
2.期貨-短部位(Futures -Short Positions)	206,566	0.36%	213,583	0.34%	-7,017	-3.29%
3.買入選擇權(Bought Options)	86,663	0.15%	85,633	0.13%	1,030	1.20%
4.賣出選擇權(Sold Options)	10,391	0.02%	12,161	0.02%	-1,770	-14.55%
二、名目本金餘額	58,202,083	100.00%	63,474,364	100.00%	-5,272,281	-8.31%
(一)交易目的之契約總額	57,943,939	99.56%	62,988,300	99.23%	-5,044,361	-8.01%
(二)非交易目的之契約總額	258,144	0.44%	486,064	0.77%	-227,920	-46.89%

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)。