

附表1

銀行衍生性金融商品餘額季報表

97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	40,091,497	17,307,802	54,734	152,996	204,745	9,959	57,821,733
(一)店頭市場(OTC)	38,958,958	17,307,802	33,275	152,995	204,745	9,959	56,667,734
1.遠期契約(Forwards)	161,795	10,393,781	-	338	-	-	10,555,914
2.交換(Swaps)	32,721,473	5,078,831	19,401	2,969	199,545	9,959	38,032,178
3.買入選擇權(Bought Options)	2,724,640	928,019	5,984	74,844	5,200	-	3,738,687
4.賣出選擇權(Sold Options)	3,351,050	907,171	7,890	74,844	-	-	4,340,955
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	1,132,539	-	21,459	1	-	-	1,153,999
1.期貨-長部位(Futures-Long Positions)	558,940	-	454	-	-	-	559,394
2.期貨-短部位(Futures-Short Positions)	566,071	-	697	1	-	-	566,769
3.買入選擇權(Bought Options)	7,528	-	8,417	-	-	-	15,945
4.賣出選擇權(Sold Options)	-	-	11,891	-	-	-	11,891
二、名目本金餘額	40,091,497	17,307,803	54,734	152,996	204,745	9,959	57,821,734
(一)交易目的之契約總額	39,822,474	17,293,587	54,734	152,996	199,782	9,959	57,533,532
(二)非交易目的之契約總額	269,023	14,216	-	-	4,963	-	288,202

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%
98.00%
18.26%
65.77%
6.46%
7.51%
2.00%
0.97%
0.98%
0.03%
0.02%
100.00%
99.50%
0.50%

附表2

銀行衍生性金融商品名目本金餘額季報比較表

97年6月底

單位：新臺幣百萬元

項 目	97年6月底		97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	57,821,733	100.00%	57,720,819	100.00%	100,914	0.17%
(一)店頭市場(OTC)	56,667,734	98.00%	56,716,170	98.26%	-48,436	-0.09%
1.遠期契約(Forwards)	10,555,914	18.26%	10,981,262	19.02%	-425,348	-3.87%
2.交換(Swaps)	38,032,178	65.77%	36,340,183	62.96%	1,691,995	4.66%
3.買入選擇權(Bought Options)	3,738,687	6.46%	4,547,036	7.88%	-808,349	-17.78%
4.賣出選擇權(Sold Options)	4,340,955	7.51%	4,847,689	8.40%	-506,734	-10.45%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	1,153,999	2.00%	1,004,649	1.74%	149,350	14.87%
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	559,394	0.97%	530,682	0.92%	28,712	5.41%
2.期貨-短部位(Futures -Short Positions)	566,769	0.98%	452,641	0.78%	114,128	25.21%
3.買入選擇權(Bought Options)	15,945	0.03%	12,319	0.02%	3,626	29.43%
4.賣出選擇權(Sold Options)	11,891	0.02%	9,007	0.02%	2,884	32.02%
二、名目本金餘額	57,821,734	100.00%	57,720,819	100.00%	100,915	0.17%
(一)交易目的之契約總額	57,533,532	99.50%	57,381,288	99.41%	152,244	0.27%
(二)非交易目的之契約總額	288,202	0.50%	339,531	0.59%	-51,329	-15.12%

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)。