

附表1

## 銀行衍生性金融商品餘額季報表

97年9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
<b>一、名日本金餘額</b>	<b>41,812,597</b>	<b>18,717,832</b>	<b>45,526</b>	<b>216,611</b>	<b>203,778</b>	<b>10,257</b>	<b>61,006,601</b>
(一)店頭市場(OTC)	40,877,667	18,717,832	27,746	216,454	203,778	10,257	60,053,734
1.遠期契約(Forwards)	107,014	11,554,477	-	118	-	-	11,661,609
2.交換(Swaps)	34,967,853	5,538,353	14,165	5,750	199,878	10,257	40,736,256
3.買入選擇權(Bought Options)	2,622,630	800,020	5,994	105,293	3,900	-	3,537,837
4.賣出選擇權(Sold Options)	3,180,170	824,982	7,587	105,293	-	-	4,118,032
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	934,930	-	17,780	157	-	-	952,867
1.期貨-長部位(Futures-Long Positions)	457,279	-	-	-	-	-	457,279
2.期貨-短部位(Futures-Short Positions)	457,382	-	1,435	157	-	-	458,974
3.買入選擇權(Bought Options)	14,137	-	9,963	-	-	-	24,100
4.賣出選擇權(Sold Options)	6,132	-	6,382	-	-	-	12,514
<b>二、名日本金餘額</b>	<b>41,812,597</b>	<b>18,717,832</b>	<b>45,526</b>	<b>216,611</b>	<b>203,778</b>	<b>10,257</b>	<b>61,006,601</b>
(一)交易目的之契約總額	41,553,765	18,703,009	45,526	216,611	203,263	10,257	60,732,431
(二)非交易目的之契約總額	258,832	14,823	-	-	515	-	274,170

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
<b>100.00%</b>
98.44%
19.12%
66.77%
5.80%
6.75%
1.56%
0.75%
0.75%
0.04%
0.02%
<b>100.00%</b>
99.55%
0.45%

## 銀行衍生性金融商品名目本金餘額季報比較表

97年9月底

單位：新臺幣百萬元

項 目	97年9月底		97年6月底		比 較 增 減	
	合計	百分比	合計	百分比	合計	百分比
<b>一、名目本金餘額</b>	<b>61,006,601</b>	<b>100.00%</b>	<b>57,821,733</b>	<b>100.00%</b>	<b>3,184,868</b>	<b>5.51%</b>
(一)店頭市場(OTC)	60,053,734	98.44%	56,667,734	98.00%	3,386,000	5.98%
1.遠期契約(Forwards)	11,661,609	19.12%	10,555,914	18.26%	1,105,695	10.47%
2.交換(Swaps)	40,736,256	66.77%	38,032,178	65.77%	2,704,078	7.11%
3.買入選擇權(Bought Options)	3,537,837	5.80%	3,738,687	6.46%	-200,850	-5.37%
4.賣出選擇權(Sold Options)	4,118,032	6.75%	4,340,955	7.51%	-222,923	-5.14%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	952,867	1.56%	1,153,999	2.00%	-201,132	-17.43%
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	457,279	0.75%	559,394	0.97%	-102,115	-18.25%
2.期貨-短部位(Futures -Short Positions)	458,974	0.75%	566,769	0.98%	-107,795	-19.02%
3.買入選擇權(Bought Options)	24,100	0.04%	15,945	0.03%	8,155	51.14%
4.賣出選擇權(Sold Options)	12,514	0.02%	11,891	0.02%	623	5.24%
<b>二、名目本金餘額</b>	<b>61,006,601</b>	<b>100.00%</b>	<b>57,821,733</b>	<b>100.00%</b>	<b>3,184,868</b>	<b>5.51%</b>
(一)交易目的之契約總額	60,732,431	99.55%	57,533,532	99.50%	3,198,899	5.56%
(二)非交易目的之契約總額	274,170	0.45%	288,201	0.50%	-14,031	-4.87%

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)。