

附表1

銀行衍生性金融商品餘額季報表

97年12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	42,872,153	16,301,507	36,151	297,697	161,507	10,029	59,679,044
(一)店頭市場(OTC)	41,884,359	16,301,507	28,348	297,566	161,507	10,029	58,683,316
1.遠期契約(Forwards)	114,035	9,636,947	-	1,852	-	-	9,752,834
2.交換(Swaps)	36,224,069	5,464,598	13,457	4,180	157,607	10,029	41,873,940
3.買入選擇權(Bought Options)	2,660,349	599,281	7,487	145,767	3,900	-	3,416,784
4.賣出選擇權(Sold Options)	2,885,906	600,681	7,404	145,767	-	-	3,639,758
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	987,794	-	7,803	131	-	-	995,728
1.期貨-長部位(Futures-Long Positions)	484,361	-	-	131	-	-	484,492
2.期貨-短部位(Futures-Short Positions)	494,322	-	408	-	-	-	494,730
3.買入選擇權(Bought Options)	9,111	-	4,580	-	-	-	13,691
4.賣出選擇權(Sold Options)	-	-	2,815	-	-	-	2,815
二、名目本金餘額	42,872,153	16,301,507	36,151	297,697	161,507	10,029	59,679,044
(一)交易目的之契約總額	42,638,631	16,288,792	36,151	297,697	160,985	10,029	59,432,285
(二)非交易目的之契約總額	233,522	12,715	-	-	522	-	246,759

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%
98.34%
16.34%
70.17%
5.73%
6.10%
1.66%
0.81%
0.83%
0.02%
0.00%
100.00%
99.59%
0.41%

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12月底

單位：新臺幣百萬元

項 目	97年12月底		97年9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	59,679,044	100.00%	61,006,601	100.00%	-1,327,557	-2.18%
(一)店頭市場(OTC)	58,683,316	98.34%	60,053,734	98.44%	-1,370,418	-2.28%
1.遠期契約(Forwards)	9,752,834	16.34%	11,661,609	19.12%	-1,908,775	-16.37%
2.交換(Swaps)	41,873,940	70.17%	40,736,256	66.77%	1,137,684	2.79%
3.買入選擇權(Bought Options)	3,416,784	5.73%	3,537,837	5.80%	-121,053	-3.42%
4.賣出選擇權(Sold Options)	3,639,758	6.10%	4,118,032	6.75%	-478,274	-11.61%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	995,728	1.66%	952,867	1.56%	42,861	4.50%
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	484,492	0.81%	457,279	0.75%	27,213	5.95%
2.期貨-短部位(Futures -Short Positions)	494,730	0.83%	458,974	0.75%	35,756	7.79%
3.買入選擇權(Bought Options)	13,691	0.02%	24,100	0.04%	-10,409	-43.19%
4.賣出選擇權(Sold Options)	2,815	0.00%	12,514	0.02%	-9,699	-77.51%
二、名目本金餘額	59,679,044	100.00%	61,006,601	100.00%	-1,327,557	-2.18%
(一)交易目的之契約總額	59,432,285	99.59%	60,732,431	99.55%	-1,300,146	-2.14%
(二)非交易目的之契約總額	246,759	0.41%	274,170	0.45%	-27,411	-10.00%

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)。