

附表1

銀行衍生性金融商品餘額季報表

97年3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	39,658,116	17,653,291	60,892	150,474	188,385	9,661	57,720,819
(一)店頭市場(OTC)	38,680,162	17,653,291	34,197	150,474	188,385	9,661	56,716,170
1.遠期契約(Forwards)	303,794	10,677,303	27	138	-	-	10,981,262
2.交換(Swaps)	31,072,796	5,051,566	20,453	2,522	183,185	9,661	36,340,183
3.買入選擇權(Bought Options)	3,490,235	971,560	6,134	73,907	5,200	-	4,547,036
4.賣出選擇權(Sold Options)	3,813,337	952,862	7,583	73,907	-	-	4,847,689
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	977,954	-	26,695	-	-	-	1,004,649
1.期貨-長部位(Futures-Long Positions)	526,461	-	4,221	-	-	-	530,682
2.期貨-短部位(Futures-Short Positions)	451,493	-	1,148	-	-	-	452,641
3.買入選擇權(Bought Options)	-	-	12,319	-	-	-	12,319
4.賣出選擇權(Sold Options)	-	-	9,007	-	-	-	9,007
二、名目本金餘額	39,658,116	17,653,291	60,892	150,474	188,385	9,661	57,720,819
(一)交易目的之契約總額	39,391,441	17,603,060	60,892	150,474	165,760	9,661	57,381,288
(二)非交易目的之契約總額	266,675	50,231	-	-	22,625	-	339,531

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%
98.26%
19.02%
62.96%
7.88%
8.40%
1.74%
0.92%
0.78%
0.02%
0.02%
100.00%
99.41%
0.59%

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3月底

單位：新臺幣百萬元

項 目	97年3月底		96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	57,720,819	100.00%	54,684,140	100.00%	3,036,679	5.55%
(一)店頭市場(OTC)	56,716,170	98.26%	51,795,153	94.72%	4,921,017	9.50%
1.遠期契約(Forwards)	10,981,262	19.02%	9,593,630	17.54%	1,387,632	14.46%
2.交換(Swaps)	36,340,183	62.96%	33,253,829	60.81%	3,086,354	9.28%
3.買入選擇權(Bought Options)	4,547,036	7.88%	4,241,122	7.76%	305,914	7.21%
4.賣出選擇權(Sold Options)	4,847,689	8.40%	4,706,572	8.61%	141,117	3.00%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	1,004,649	1.74%	2,888,987	5.28%	-1,884,338	-65.22%
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	530,682	0.92%	1,384,916	2.53%	-854,234	-61.68%
2.期貨-短部位(Futures -Short Positions)	452,641	0.78%	1,488,720	2.72%	-1,036,079	-69.60%
3.買入選擇權(Bought Options)	12,319	0.02%	7,479	0.01%	4,840	64.71%
4.賣出選擇權(Sold Options)	9,007	0.02%	7,872	0.02%	1,135	14.42%
二、名目本金餘額	57,720,819	100.00%	54,684,140	100.00%	3,036,679	5.55%
(一)交易目的之契約總額	57,381,288	99.41%	54,373,244	99.43%	3,008,044	5.53%
(二)非交易目的之契約總額	339,531	0.59%	310,896	0.57%	28,635	9.21%

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)。