

附表1

銀行衍生性金融商品交易量彙總表

97年8月份

單位：新臺幣百萬元

商 品 種 類	本國銀行國內總分支機構及外國銀行在台分行			
	涉及新臺幣交易	純外幣交易	合 計	百分比
一、利率有關契約(Interest Rate Contracts)	559,415	1,125,128	1,684,543	21.66%
(一)店頭市場(OTC)	482,572	448,027	930,599	11.97%
1.遠期利率協議(FRA)	1,500	11,347	12,847	0.17%
2.換利(IRS)	442,935	428,034	870,969	11.20%
3.買入選擇權(Bought Options)	19,939	3,320	23,259	0.30%
4.賣出選擇權(Sold Options)	18,198	5,326	23,524	0.30%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	76,843	677,101	753,944	9.69%
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	38,395	323,389	361,784	4.65%
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	38,448	321,222	359,670	4.62%
3.買入選擇權(Bought Options)	-	17,116	17,116	0.22%
4.賣出選擇權(Sold Options)	-	15,374	15,374	0.20%
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	2,323,119	3,360,930	5,684,049	73.08%
(一)店頭市場(OTC)	2,323,119	3,360,930	5,684,049	73.08%
1.遠期契約(Outright Forwards)	685,413	452,106	1,137,519	14.62%
2.換匯(Fx Swaps)	1,453,589	2,160,222	3,613,811	46.46%
3.換匯換利(Currency Swaps)	105,494	10,233	115,727	1.49%
4.買入選擇權(Bought Options)	37,857	377,270	415,127	5.34%
5.賣出選擇權(Sold Options)	40,766	361,099	401,865	5.17%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	-	-	-
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	-	-	-	-
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	-	-	-	-
3.買入選擇權(Bought Options)	-	-	-	-
4.賣出選擇權(Sold Options)	-	-	-	-
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	300,336	12,906	313,242	4.03%
(一)店頭市場(OTC)	-	120	120	0.00%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	300,336	12,786	313,122	4.03%
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	25,749	59,785	85,534	1.10%
(一)店頭市場(OTC)	-	59,745	59,745	0.77%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	25,749	40	25,789	0.33%
小 計(一至四)	3,208,619	4,558,749	7,767,368	99.87%
五、信用有關契約(Credit Contracts)	100	10,143	10,243	0.13%
1.信用違約交換(Credit Default Swap)	100	10,143	10,243	0.13%
2.買入信用違約選擇權(Bought Credit Default Options)	-	-	-	-
3.賣出信用違約選擇權(Sold Credit Default Options)	-	-	-	-
4.其他(Other)	-	-	-	-
六、其他有關契約(Other Contracts)	-	-	-	-
1.遠期契約(Outright Forwards)	-	-	-	-
2.交換(Swaps)	-	-	-	-
3.選擇權(Options)	-	-	-	-
總 計	3,208,719	4,568,892	7,777,611	100.00%

註：1.本表已剔除銀行間交易重複計算部分。

2.本國銀行國內總分支機構及外國銀行在台分行係包括國際金融業務分行資料。

3.「匯率有關—遠期契約」中「涉及新臺幣交易」金額包括新臺幣對外幣無本金交割遠期外匯交易；「純外幣交易」金額包括外幣保證金交易以遠期契約承作者。

附表1

4. 信用有關契約自93年1月份開始統計，其他有關契約自94年1月份開始統計。

銀行衍生性金融商品交易量比較表

97年8月份

單位：新臺幣百萬元

商 品 種 類	97年8月		97年7月		比較增減	
	合 計	百分比	合 計	百分比	合 計	百分比
一、利率有關契約 (Interest Rate Contracts)	1,684,543	21.66%	2,071,806	23.69%	-387,263	-18.69%
(一)店頭市場(OTC)	930,599	11.97%	1,076,650	12.31%	-146,051	-13.57%
1. 遠期利率協議(FRA)	12,847	0.17%	21,474	0.25%	-8,627	-40.17%
2. 換利(IRS)	870,969	11.20%	939,667	10.74%	-68,698	-7.31%
3. 買入選擇權(Bought Options)	23,259	0.30%	55,304	0.63%	-32,045	-57.94%
4. 賣出選擇權(Sold Options)	23,524	0.30%	60,205	0.69%	-36,681	-60.93%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	753,944	9.69%	995,156	11.38%	-241,212	-24.24%
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	361,784	4.65%	491,008	5.62%	-129,224	-26.32%
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	359,670	4.62%	498,642	5.70%	-138,972	-27.87%
3. 買入選擇權(Bought Options)	17,116	0.22%	2,753	0.03%	14,363	521.72%
4. 賣出選擇權(Sold Options)	15,374	0.20%	2,753	0.03%	12,621	458.45%
二、匯率有關契約 (Foreign Exchange Transactions)	5,684,049	73.08%	6,085,706	69.58%	-401,657	-6.60%
(一)店頭市場(OTC)	5,684,049	73.08%	6,085,706	69.58%	-401,657	-6.60%
1. 遠期契約(Outright Forwards)	1,137,519	14.62%	1,115,298	12.75%	22,221	1.99%
2. 換匯(Fx Swaps)	3,613,811	46.46%	3,793,206	43.37%	-179,395	-4.73%
3. 換匯換利(Currency Swaps)	115,727	1.49%	121,756	1.39%	-6,029	-4.95%
4. 買入選擇權(Bought Options)	415,127	5.34%	538,999	6.16%	-123,872	-22.98%
5. 賣出選擇權(Sold Options)	401,865	5.17%	516,447	5.91%	-114,582	-22.19%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	-	-	-	-	-
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	-	-	-	-	-	-
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	-	-	-	-	-	-
3. 買入選擇權(Bought Options)	-	-	-	-	-	-
4. 賣出選擇權(Sold Options)	-	-	-	-	-	-
三、權益證券有關契約 (Equity-linked Contracts)	313,242	4.03%	385,279	4.41%	-72,037	-18.70%
(一)店頭市場(OTC)	120	0.00%	315	0.01%	-195	-61.90%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	313,122	4.03%	384,964	4.40%	-71,842	-18.66%
四、商品有關契約 (Commodity Contracts)	85,534	1.10%	197,939	2.26%	-112,405	-56.79%
(一)店頭市場(OTC)	59,745	0.77%	166,500	1.90%	-106,755	-64.12%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	25,789	0.33%	31,439	0.36%	-5,650	-17.97%
小 計(一至四)	7,767,368	99.87%	8,740,730	99.94%	-973,362	-11.14%
五、信用有關契約 (Credit Contracts)	10,243	0.13%	5,499	0.06%	4,744	86.27%
1. 信用違約交換(Credit Default Swap)	10,243	0.13%	5,499	0.06%	4,744	86.27%
2. 買入信用違約選擇權(Bought Credit Default Options)	-	-	-	-	-	-
3. 賣出信用違約選擇權(Sold Credit Default Options)	-	-	-	-	-	-
4. 其他(Other)	-	-	-	-	-	-
六、其他有關契約 (Other Contracts)	-	-	-	-	-	-
1. 遠期契約(Outright Forwards)	-	-	-	-	-	-
2. 交換(Swaps)	-	-	-	-	-	-
3. 選擇權(Options)	-	-	-	-	-	-
總 計	7,777,611	100.00%	8,746,229	100.00%	-968,618	-11.07%

註：1. 本表已剔除銀行間交易重複計算部分。

2. 本國銀行國內總分支機構及外國銀行在台分行係包括國際金融業務分行資料。

3. 「匯率有關—遠期契約」中「涉及新臺幣交易」金額包括新臺幣對外幣無本金交割遠期外匯交易；「純外幣交易」金額包括外幣保證金交易以遠期契約承作者。

附表2

4. 信用有關契約自93年1月份開始統計，其他有關契約自94年1月份開始統計。