

附表1

銀行衍生性金融商品交易量彙總表

97年11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)	395,439	907,789	1,303,228	21.12%
(一)店頭市場(OTC)	317,110	525,534	842,644	13.66%
1.遠期利率協議(FRA)	-	48,944	48,944	0.79%
2.換利(IRS)	226,351	474,543	700,894	11.36%
3.買入選擇權(Bought Options)	43,498	33	43,531	0.71%
4.賣出選擇權(Sold Options)	47,261	2,014	49,275	0.80%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	78,329	382,255	460,584	7.46%
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	38,890	211,135	250,025	4.05%
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	39,439	158,891	198,330	3.22%
3.買入選擇權(Bought Options)	-	6,988	6,988	0.11%
4.賣出選擇權(Sold Options)	-	5,241	5,241	0.08%
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	2,041,656	2,574,404	4,616,060	74.82%
(一)店頭市場(OTC)	2,041,656	2,574,404	4,616,060	74.82%
1.遠期契約(Outright Forwards)	451,988	392,203	844,191	13.68%
2.換匯(Fx Swaps)	1,486,574	1,821,092	3,307,666	53.61%
3.換匯換利(Currency Swaps)	62,822	2,272	65,094	1.06%
4.買入選擇權(Bought Options)	19,284	185,447	204,731	3.32%
5.賣出選擇權(Sold Options)	20,988	173,390	194,378	3.15%
(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)	171,868	4,906	176,774	2.86%
(一)店頭市場(OTC)	18	-	18	0.00%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	171,850	4,906	176,756	2.86%
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	26,624	43,863	70,487	1.15%
(一)店頭市場(OTC)	-	42,987	42,987	0.70%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	26,624	876	27,500	0.45%
小 計(一至四)	2,635,587	3,530,962	6,166,549	99.95%
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	2,993	2,993	0.05%
1.信用違約交換(Credit Default Swap)	-	2,993	2,993	0.05%
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	2,635,587	3,533,955	6,169,542	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11月份

單位：新臺幣百萬元

商 品 種 類	97年11月		97年10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)	1,303,228	21.12%	1,463,731	15.80%	-160,504	-10.97%
(一)店頭市場(OTC)	842,644	13.66%	836,054	9.02%	6,590	0.79%
1. 遠期利率協議(FRA)	48,944	0.79%	66,563	0.72%	-17,619	-26.47%
2. 換利(IRS)	700,894	11.36%	677,122	7.31%	23,772	3.51%
3. 買入選擇權(Bought Options)	43,531	0.71%	57,539	0.62%	-14,008	-24.35%
4. 賣出選擇權(Sold Options)	49,275	0.80%	34,830	0.38%	14,445	41.47%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	460,584	7.46%	627,677	6.77%	-167,093	-26.62%
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	250,025	4.05%	370,898	4.00%	-120,873	-32.59%
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	198,330	3.22%	216,238	2.33%	-17,908	-8.28%
3. 買入選擇權(Bought Options)	6,988	0.11%	20,048	0.22%	-13,060	-65.14%
4. 賣出選擇權(Sold Options)	5,241	0.08%	20,493	0.22%	-15,252	-74.43%
二、匯率有關契約 (Foreign Exchange Transactions)	4,616,060	74.82%	7,462,691	80.54%	-2,846,631	-38.14%
(一)店頭市場(OTC)	4,616,060	74.82%	7,462,691	80.54%	-2,846,631	-38.14%
1. 遠期契約(Outright Forwards)	844,191	13.68%	1,900,761	20.51%	-1,056,570	-55.59%
2. 換匯(Fx Swaps)	3,307,666	53.61%	4,879,290	52.66%	-1,571,624	-32.21%
3. 換匯換利(Currency Swaps)	65,094	1.06%	113,474	1.22%	-48,380	-42.64%
4. 買入選擇權(Bought Options)	204,731	3.32%	292,552	3.16%	-87,821	-30.02%
5. 賣出選擇權(Sold Options)	194,378	3.15%	276,614	2.99%	-82,236	-29.73%
(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)	176,774	2.86%	264,705	2.86%	-87,931	-33.22%
(一)店頭市場(OTC)	18	0.00%	30	0.00%	-12	-40.00%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	176,756	2.86%	264,675	2.86%	-87,919	-33.22%
四、商品有關契約 (Commodity Contracts)	70,487	1.15%	66,557	0.72%	3,930	5.90%
(一)店頭市場(OTC)	42,987	0.70%	37,615	0.41%	5,372	14.28%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	27,500	0.45%	28,942	0.31%	-1,442	-4.98%
小 計(一至四)	6,166,549	99.95%	9,257,684	99.92%	-3,091,136	-33.39%
五、信用有關契約 (Credit Contracts)	2,993	0.05%	7,706	0.08%	-4,713	-61.16%
1. 信用違約交換(Credit Default Swap)	2,993	0.05%	7,706	0.08%	-4,713	-61.16%
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	6,169,542	100.00%	9,265,390	100.00%	-3,095,849	-33.41%

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。