

銀行衍生性金融商品交易量彙總表

97年9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)	901,189	1,658,652	2,559,841	26.27%
(一)店頭市場(OTC)	560,780	664,600	1,225,380	12.58%
1.遠期利率協議(FRA)	309	28,598	28,907	0.30%
2.換利(IRS)	500,737	615,508	1,116,245	11.45%
3.買入選擇權(Bought Options)	32,160	18,097	50,257	0.51%
4.賣出選擇權(Sold Options)	27,574	2,397	29,971	0.31%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	340,409	994,052	1,334,461	13.70%
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	170,186	438,086	608,272	6.24%
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	170,223	521,538	691,761	7.10%
3.買入選擇權(Bought Options)	-	17,214	17,214	0.18%
4.賣出選擇權(Sold Options)	-	17,214	17,214	0.18%
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	2,254,662	4,476,450	6,731,112	69.08%
(一)店頭市場(OTC)	2,254,662	4,476,450	6,731,112	69.08%
1.遠期契約(Outright Forwards)	626,753	1,037,885	1,664,638	17.08%
2.換匯(Fx Swaps)	1,472,627	2,734,864	4,207,491	43.18%
3.換匯換利(Currency Swaps)	99,205	2,348	101,553	1.04%
4.買入選擇權(Bought Options)	28,610	363,619	392,229	4.03%
5.賣出選擇權(Sold Options)	27,467	337,734	365,201	3.75%
(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)	332,179	15,351	347,530	3.57%
(一)店頭市場(OTC)	139	-	139	0.00%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	332,040	15,351	347,391	3.57%
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	30,484	66,890	97,374	1.00%
(一)店頭市場(OTC)	-	66,228	66,228	0.68%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	30,484	662	31,146	0.32%
小 計(一至四)	3,518,514	6,217,343	9,735,857	99.92%
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	8,067	8,067	0.08%
1.信用違約交換(Credit Default Swap)	-	8,067	8,067	0.08%
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	3,518,514	6,225,410	9,743,924	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9月份

單位：新臺幣百萬元

商 品 種 類	97年9月		97年8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)	2,559,841	26.27%	1,684,543	21.66%	875,298	51.96%
(一)店頭市場(OTC)	1,225,380	12.57%	930,599	11.97%	294,781	31.68%
1. 遠期利率協議(FRA)	28,907	0.30%	12,847	0.17%	16,060	125.01%
2. 換利(IRS)	1,116,245	11.45%	870,969	11.20%	245,276	28.16%
3. 買入選擇權(Bought Options)	50,257	0.51%	23,259	0.30%	26,998	116.08%
4. 賣出選擇權(Sold Options)	29,971	0.31%	23,524	0.30%	6,447	27.41%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	1,334,461	13.70%	753,944	9.69%	580,517	77.00%
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	608,272	6.24%	361,784	4.65%	246,488	68.13%
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	691,761	7.10%	359,670	4.62%	332,091	92.33%
3. 買入選擇權(Bought Options)	17,214	0.18%	17,116	0.22%	98	0.57%
4. 賣出選擇權(Sold Options)	17,214	0.18%	15,374	0.20%	1,840	11.97%
二、匯率有關契約 (Foreign Exchange Transactions)	6,731,112	69.08%	5,684,049	73.08%	1,047,063	18.42%
(一)店頭市場(OTC)	6,731,112	69.08%	5,684,049	73.08%	1,047,063	18.42%
1. 遠期契約(Outright Forwards)	1,664,638	17.08%	1,137,519	14.62%	527,119	46.34%
2. 換匯(Fx Swaps)	4,207,491	43.18%	3,613,811	46.46%	593,680	16.43%
3. 換匯換利(Currency Swaps)	101,553	1.04%	115,727	1.49%	-14,174	-12.25%
4. 買入選擇權(Bought Options)	392,229	4.03%	415,127	5.34%	-22,898	-5.52%
5. 賣出選擇權(Sold Options)	365,201	3.75%	401,865	5.17%	-36,664	-9.12%
(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)	347,530	3.57%	313,242	4.03%	34,288	10.95%
(一)店頭市場(OTC)	139	0.00%	120	0.00%	19	15.42%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	347,391	3.57%	313,122	4.03%	34,269	10.94%
四、商品有關契約 (Commodity Contracts)	97,374	1.00%	85,534	1.10%	11,840	13.84%
(一)店頭市場(OTC)	66,228	0.68%	59,745	0.77%	6,483	10.85%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	31,146	0.32%	25,789	0.33%	5,357	20.77%
小 計(一至四)	9,735,857	99.92%	7,767,368	99.87%	1,968,489	25.34%
五、信用有關契約 (Credit Contracts)	8,067	0.08%	10,243	0.13%	-2,176	-21.24%
1. 信用違約交換(Credit Default Swap)	8,067	0.08%	10,243	0.13%	-2,176	-21.24%
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	9,743,924	100.00%	7,777,611	100.00%	1,966,313	25.28%

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。