

附表1

銀行衍生性金融商品交易量彙總表

97年4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)	1, 243, 584	1, 257, 067	2, 500, 651	27. 83%
(一)店頭市場(OTC)	692, 220	425, 296	1, 117, 516	12. 44%
1. 遠期利率協議(FRA)	-	37, 147	37, 147	0. 41%
2. 換利(IRS)	533, 206	371, 427	904, 633	10. 07%
3. 買入選擇權(Bought Options)	78, 270	6, 078	84, 348	0. 94%
4. 賣出選擇權(Sold Options)	80, 744	10, 644	91, 388	1. 02%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	551, 364	831, 771	1, 383, 135	15. 39%
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	275, 947	448, 620	724, 567	8. 06%
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	275, 417	383, 151	658, 568	7. 33%
3. 買入選擇權(Bought Options)	-	-	-	-
4. 賣出選擇權(Sold Options)	-	-	-	-
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	2, 173, 018	3, 957, 510	6, 130, 528	68. 24%
(一)店頭市場(OTC)	2, 173, 018	3, 957, 510	6, 130, 528	68. 24%
1. 遠期契約(Outright Forwards)	714, 425	630, 670	1, 345, 095	14. 97%
2. 換匯(Fx Swaps)	1, 283, 487	2, 475, 452	3, 758, 939	41. 84%
3. 換匯換利(Currency Swaps)	115, 631	6, 981	122, 612	1. 37%
4. 買入選擇權(Bought Options)	32, 733	436, 149	468, 882	5. 22%
5. 賣出選擇權(Sold Options)	26, 742	408, 258	435, 000	4. 84%
(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)	261, 854	4, 345	266, 199	2. 96%
(一)店頭市場(OTC)	811	278	1, 089	0. 01%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	261, 043	4, 067	265, 110	2. 95%
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	30, 614	44, 099	74, 713	0. 83%
(一)店頭市場(OTC)	-	44, 040	44, 040	0. 49%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	30, 614	59	30, 673	0. 34%
小 計(一至四)	3, 709, 070	5, 263, 021	8, 972, 091	99. 86%
五、信用有關契約(Credit Contracts)	150	11, 915	12, 065	0. 14%
1. 信用違約交換(Credit Default Swap)	150	11, 611	11, 761	0. 14%
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)	-	304	304	0. 00%
六、其他有關契約(Other Contracts)	-	304	304	0. 00%
1. 遠期契約(Outright Forwards)	-	-	-	-
2. 交換(Swaps)	-	304	304	0. 00%
3. 選擇權(Options)	-	-	-	-
總 計	3, 709, 220	5, 275, 240	8, 984, 460	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4月份

單位：新臺幣百萬元

商 品 種 類	97年4月		97年3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)	2,500,651	27.83%	2,946,655	29.76%	-446,004	-15.14%
(一)店頭市場(OTC)	1,117,516	12.44%	1,654,773	16.71%	-537,257	-32.47%
1. 遠期利率協議(FRA)	37,147	0.41%	15,202	0.15%	21,945	144.36%
2. 換利(IRS)	904,633	10.07%	1,438,916	14.53%	-534,283	-37.13%
3. 買入選擇權(Bought Options)	84,348	0.94%	118,332	1.20%	-33,984	-28.72%
4. 賣出選擇權(Sold Options)	91,388	1.02%	82,323	0.83%	9,065	11.01%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	1,383,135	15.39%	1,291,882	13.05%	91,253	7.06%
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	724,567	8.06%	674,907	6.81%	49,660	7.36%
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	658,568	7.33%	605,915	6.12%	52,653	8.69%
3. 買入選擇權(Bought Options)	-	-	4,566	0.05%	-4,566	-100.00%
4. 賣出選擇權(Sold Options)	-	-	6,494	0.07%	-6,494	-100.00%
二、匯率有關契約 (Foreign Exchange Transactions)	6,130,528	68.24%	6,552,712	66.16%	-422,184	-6.44%
(一)店頭市場(OTC)	6,130,528	68.24%	6,552,712	66.16%	-422,184	-6.44%
1. 遠期契約(Outright Forwards)	1,345,095	14.97%	1,469,330	14.84%	-124,235	-8.46%
2. 換匯(Fx Swaps)	3,758,939	41.84%	4,051,892	40.91%	-292,953	-7.23%
3. 換匯換利(Currency Swaps)	122,612	1.37%	141,461	1.43%	-18,849	-13.32%
4. 買入選擇權(Bought Options)	468,882	5.22%	458,031	4.62%	10,851	2.37%
5. 賣出選擇權(Sold Options)	435,000	4.84%	431,998	4.36%	3,002	0.69%
(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)	266,199	2.96%	358,687	3.62%	-92,488	-25.79%
(一)店頭市場(OTC)	1,089	0.01%	400	0.00%	689	172.25%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	265,110	2.95%	358,287	3.62%	-93,177	-26.01%
四、商品有關契約 (Commodity Contracts)	74,713	0.83%	41,529	0.42%	33,184	79.91%
(一)店頭市場(OTC)	44,040	0.49%	41,184	0.42%	2,856	6.93%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	30,673	0.34%	345	0.00%	30,328	8790.72%
小 計(一至四)	8,972,091	99.86%	9,899,583	99.96%	-927,492	-9.37%
五、信用有關契約 (Credit Contracts)	12,065	0.14%	4,200	0.04%	7,865	187.26%
1. 信用違約交換(Credit Default Swap)	11,761	0.14%	4,200	0.04%	7,561	180.02%
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)	304	0.00%	-	-	304	-
六、其他有關契約 (Other Contracts)	304	0.00%	-	-	304	-
1. 遠期契約(Outright Forwards)	-	-	-	-	-	-
2. 交換(Swaps)	304	0.00%	-	-	304	-
3. 選擇權(Options)	-	-	-	-	-	-
總 計	8,984,460	100.00%	9,903,783	100.00%	-919,323	-9.28%

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。