

附表1

銀行衍生性金融商品交易量彙總表

97年6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, 221, 952	1, 627, 704	2, 849, 656	31. 18%
(一)店頭市場(OTC)	772, 452	436, 329	1, 208, 781	13. 23%
1. 遠期利率協議(FRA)	-	21, 855	21, 855	0. 24%
2. 換利(IRS)	696, 550	397, 319	1, 093, 869	11. 97%
3. 買入選擇權(Bought Options)	39, 000	285	39, 285	0. 43%
4. 賣出選擇權(Sold Options)	36, 902	16, 870	53, 772	0. 59%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	449, 500	1, 191, 375	1, 640, 875	17. 95%
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	224, 880	591, 498	816, 378	8. 93%
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	224, 620	589, 254	813, 874	8. 91%
3. 買入選擇權(Bought Options)	-	3, 035	3, 035	0. 03%
4. 賣出選擇權(Sold Options)	-	7, 588	7, 588	0. 08%
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	2, 057, 572	3, 725, 130	5, 782, 702	63. 28%
(一)店頭市場(OTC)	2, 057, 572	3, 725, 130	5, 782, 702	63. 28%
1. 遠期契約(Outright Forwards)	557, 502	514, 461	1, 071, 963	11. 73%
2. 換匯(Fx Swaps)	1, 294, 109	2, 277, 408	3, 571, 517	39. 08%
3. 換匯換利(Currency Swaps)	88, 889	10, 179	99, 068	1. 09%
4. 買入選擇權(Bought Options)	61, 904	470, 730	532, 634	5. 83%
5. 賣出選擇權(Sold Options)	55, 168	452, 352	507, 520	5. 55%
(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)	383, 091	11, 078	394, 169	4. 31%
(一)店頭市場(OTC)	131	716	847	0. 01%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	382, 960	10, 362	393, 322	4. 30%
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	26, 511	60, 341	86, 852	0. 95%
(一)店頭市場(OTC)	-	60, 208	60, 208	0. 66%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	26, 511	133	26, 644	0. 29%
小 計(一至四)	3, 689, 126	5, 424, 253	9, 113, 379	99. 72%
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	25, 549	25, 549	0. 28%
1. 信用違約交換(Credit Default Swap)	-	25, 549	25, 549	0. 28%
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, 689, 126	5, 449, 802	9, 138, 928	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6月份

單位：新臺幣百萬元

商 品 種 類	97年6月		97年5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)	2,849,656	31.18%	2,618,623	29.34%	231,033	8.82%
(一)店頭市場(OTC)	1,208,781	13.23%	1,018,318	11.41%	190,463	18.70%
1. 遠期利率協議(FRA)	21,855	0.24%	34,215	0.38%	-12,360	-36.12%
2. 換利(IRS)	1,093,869	11.97%	879,035	9.85%	214,834	24.44%
3. 買入選擇權(Bought Options)	39,285	0.43%	51,616	0.58%	-12,331	-23.89%
4. 賣出選擇權(Sold Options)	53,772	0.59%	53,452	0.60%	320	0.60%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	1,640,875	17.95%	1,600,305	17.93%	40,570	2.54%
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	816,378	8.93%	780,774	8.75%	35,604	4.56%
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	813,874	8.91%	789,751	8.85%	24,123	3.05%
3. 買入選擇權(Bought Options)	3,035	0.03%	17,931	0.20%	-14,896	-83.07%
4. 賣出選擇權(Sold Options)	7,588	0.08%	11,849	0.13%	-4,261	-35.96%
二、匯率有關契約 (Foreign Exchange Transactions)	5,782,702	63.28%	5,925,206	66.37%	-142,504	-2.41%
(一)店頭市場(OTC)	5,782,702	63.28%	5,925,206	66.37%	-142,504	-2.41%
1. 遠期契約(Outright Forwards)	1,071,963	11.73%	1,270,786	14.23%	-198,823	-15.65%
2. 換匯(Fx Swaps)	3,571,517	39.08%	3,568,762	39.98%	2,755	0.08%
3. 換匯換利(Currency Swaps)	99,068	1.09%	122,994	1.38%	-23,926	-19.45%
4. 買入選擇權(Bought Options)	532,634	5.83%	476,039	5.33%	56,595	11.89%
5. 賣出選擇權(Sold Options)	507,520	5.55%	486,625	5.45%	20,895	4.29%
(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)	394,169	4.31%	308,608	3.46%	85,561	27.72%
(一)店頭市場(OTC)	847	0.01%	110	0.00%	737	670.00%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	393,322	4.30%	308,498	3.46%	84,824	27.50%
四、商品有關契約 (Commodity Contracts)	86,852	0.95%	53,910	0.60%	32,942	61.10%
(一)店頭市場(OTC)	60,208	0.66%	26,754	0.30%	33,454	125.04%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	26,644	0.29%	27,156	0.30%	-512	-1.89%
小 計(一至四)	9,113,379	99.72%	8,906,347	99.77%	207,032	2.32%
五、信用有關契約 (Credit Contracts)	25,549	0.28%	20,677	0.23%	4,872	23.56%
1. 信用違約交換(Credit Default Swap)	25,549	0.28%	20,677	0.23%	4,872	23.56%
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	9,138,928	100.00%	8,927,024	100.00%	211,904	2.37%

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。