

附表1

銀行衍生性金融商品交易量彙總表

97年12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)	347,065	1,554,718	1,901,783	27.61%
(一)店頭市場(OTC)	267,063	1,072,836	1,339,899	19.45%
1. 遠期利率協議(FRA)	106	62,101	62,207	0.90%
2. 換利(IRS)	185,820	1,009,431	1,195,251	17.35%
3. 買入選擇權(Bought Options)	25,762	1,304	27,066	0.39%
4. 賣出選擇權(Sold Options)	55,375	-	55,375	0.81%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	80,002	481,882	561,884	8.16%
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	39,663	238,238	277,901	4.04%
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	40,339	243,644	283,983	4.12%
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)	2,040,995	2,593,437	4,634,432	67.28%
(一)店頭市場(OTC)	2,040,995	2,593,437	4,634,432	67.28%
1. 遠期契約(Outright Forwards)	477,156	332,063	809,219	11.75%
2. 換匯(Fx Swaps)	1,481,110	1,869,035	3,350,145	48.63%
3. 換匯換利(Currency Swaps)	38,156	2,283	40,439	0.59%
4. 買入選擇權(Bought Options)	24,508	199,946	224,454	3.26%
5. 賣出選擇權(Sold Options)	20,065	190,110	210,175	3.05%
(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)	196,335	6,259	202,594	2.94%
(一)店頭市場(OTC)	-	-	-	-
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	196,335	6,259	202,594	2.94%
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	26,530	119,576	146,106	2.12%
(一)店頭市場(OTC)	-	118,991	118,991	1.73%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	26,530	585	27,115	0.39%
小 計(一至四)	2,610,925	4,273,990	6,884,915	99.95%
五、信用有關契約(Credit Contracts)	13	3,696	3,709	0.05%
1. 信用違約交換(Credit Default Swap)	13	3,696	3,709	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	2,610,938	4,277,686	6,888,624	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。

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12月份

單位：新臺幣百萬元

商 品 種 類	97年12月		97年11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)	1,901,783	27.61%	1,303,228	21.12%	598,555	45.93%
(一)店頭市場(OTC)	1,339,899	19.45%	842,644	13.66%	497,255	59.01%
1. 遠期利率協議(FRA)	62,207	0.90%	48,944	0.79%	13,263	27.10%
2. 換利(IRS)	1,195,251	17.35%	700,894	11.36%	494,357	70.53%
3. 買入選擇權(Bought Options)	27,066	0.39%	43,531	0.71%	-16,465	-37.82%
4. 賣出選擇權(Sold Options)	55,375	0.81%	49,275	0.80%	6,100	12.38%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	561,884	8.16%	460,584	7.46%	101,300	21.99%
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	277,901	4.04%	250,025	4.05%	27,876	11.15%
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	283,983	4.12%	198,330	3.22%	85,653	43.19%
3. 買入選擇權(Bought Options)	-	-	6,988	0.11%	-6,988	-100.00%
4. 賣出選擇權(Sold Options)	-	-	5,241	0.08%	-5,241	-100.00%
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	4,634,432	67.28%	4,616,060	74.82%	18,372	0.40%
(一)店頭市場(OTC)	4,634,432	67.28%	4,616,060	74.82%	18,372	0.40%
1. 遠期契約(Outright Forwards)	809,219	11.75%	844,191	13.68%	-34,972	-4.14%
2. 換匯(Fx Swaps)	3,350,145	48.63%	3,307,666	53.61%	42,479	1.28%
3. 換匯換利(Currency Swaps)	40,439	0.59%	65,094	1.06%	-24,655	-37.88%
4. 買入選擇權(Bought Options)	224,454	3.26%	204,731	3.32%	19,723	9.63%
5. 賣出選擇權(Sold Options)	210,175	3.05%	194,378	3.15%	15,797	8.13%
(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)	202,594	2.94%	176,774	2.86%	25,820	14.61%
(一)店頭市場(OTC)	-	-	18	0.00%	-18	-100.00%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	202,594	2.94%	176,756	2.86%	25,838	14.62%
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	146,106	2.12%	70,487	1.15%	75,619	107.28%
(一)店頭市場(OTC)	118,991	1.73%	42,987	0.70%	76,004	176.81%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	27,115	0.39%	27,500	0.45%	-385	-1.40%
小 計(一至四)	6,884,915	99.95%	6,166,549	99.95%	718,367	11.65%
五、信用有關契約(Credit Contracts)	3,709	0.05%	2,993	0.05%	716	23.92%
1. 信用違約交換(Credit Default Swap)	3,709	0.05%	2,993	0.05%	716	23.92%
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	6,888,624	100.00%	6,169,542	100.00%	719,082	11.66%

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。

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。