

附表1

銀行衍生性金融商品交易量彙總表

97年3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)	610,978	2,335,677	2,946,655	29.76%
(一)店頭市場(OTC)	544,906	1,109,867	1,654,773	16.71%
1.遠期利率協議(FRA)	-	15,202	15,202	0.15%
2.換利(IRS)	432,330	1,006,586	1,438,916	14.53%
3.買入選擇權(Bought Options)	52,211	66,121	118,332	1.20%
4.賣出選擇權(Sold Options)	60,365	21,958	82,323	0.83%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	66,072	1,225,810	1,291,882	13.05%
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	32,761	642,146	674,907	6.81%
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	33,311	572,604	605,915	6.12%
3.買入選擇權(Bought Options)	-	4,566	4,566	0.05%
4.賣出選擇權(Sold Options)	-	6,494	6,494	0.07%
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	2,607,365	3,945,347	6,552,712	66.16%
(一)店頭市場(OTC)	2,607,365	3,945,347	6,552,712	66.16%
1.遠期契約(Outright Forwards)	859,428	609,902	1,469,330	14.84%
2.換匯(Fx Swaps)	1,538,287	2,513,605	4,051,892	40.91%
3.換匯換利(Currency Swaps)	139,335	2,126	141,461	1.43%
4.買入選擇權(Bought Options)	36,549	421,482	458,031	4.62%
5.賣出選擇權(Sold Options)	33,766	398,232	431,998	4.36%
(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)	345,377	13,310	358,687	3.62%
(一)店頭市場(OTC)	115	285	400	0.00%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	345,262	13,025	358,287	3.62%
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	345	41,184	41,529	0.42%
(一)店頭市場(OTC)	-	41,184	41,184	0.42%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	345	-	345	0.00%
小 計(一至四)	3,564,065	6,335,518	9,899,583	99.96%
五、信用有關契約(Credit Contracts)	387	3,813	4,200	0.04%
1.信用違約交換(Credit Default Swap)	387	3,813	4,200	0.04%
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	3,564,452	6,339,331	9,903,783	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3月份

單位：新臺幣百萬元

商 品 種 類	97年3月		97年2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)	2,946,655	29.76%	2,629,195	33.07%	317,460	12.07%
(一)店頭市場(OTC)	1,654,773	16.71%	1,211,803	15.24%	442,970	36.55%
1. 遠期利率協議(FRA)	15,202	0.15%	145,882	1.83%	-130,680	-89.58%
2. 換利(IRS)	1,438,916	14.53%	995,366	12.52%	443,550	44.56%
3. 買入選擇權(Bought Options)	118,332	1.20%	28,548	0.36%	89,784	314.50%
4. 賣出選擇權(Sold Options)	82,323	0.83%	42,007	0.53%	40,316	95.97%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	1,291,882	13.05%	1,417,392	17.83%	-125,510	-8.85%
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	674,907	6.81%	760,367	9.56%	-85,460	-11.24%
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	605,915	6.12%	653,015	8.21%	-47,100	-7.21%
3. 買入選擇權(Bought Options)	4,566	0.05%	2,832	0.04%	1,734	61.23%
4. 賣出選擇權(Sold Options)	6,494	0.07%	1,178	0.02%	5,316	451.27%
二、匯率有關契約 (Foreign Exchange Transactions)	6,552,712	66.16%	5,132,908	64.57%	1,419,804	27.66%
(一)店頭市場(OTC)	6,552,712	66.16%	5,132,908	64.57%	1,419,804	27.66%
1. 遠期契約(Outright Forwards)	1,469,330	14.84%	1,186,220	14.92%	283,110	23.87%
2. 換匯(Fx Swaps)	4,051,892	40.91%	3,025,264	38.06%	1,026,628	33.94%
3. 換匯換利(Currency Swaps)	141,461	1.43%	74,540	0.94%	66,921	89.78%
4. 買入選擇權(Bought Options)	458,031	4.62%	438,316	5.51%	19,715	4.50%
5. 賣出選擇權(Sold Options)	431,998	4.36%	408,568	5.14%	23,430	5.73%
(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)	358,687	3.62%	164,486	2.07%	194,201	118.07%
(一)店頭市場(OTC)	400	0.00%	57	0.00%	343	601.75%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	358,287	3.62%	164,429	2.07%	193,858	117.90%
四、商品有關契約 (Commodity Contracts)	41,529	0.42%	16,190	0.20%	25,339	156.51%
(一)店頭市場(OTC)	41,184	0.42%	16,190	0.20%	24,994	154.38%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	345	0.00%	-	-	345	-
小 計(一至四)	9,899,583	99.96%	7,942,779	99.91%	1,956,804	24.64%
五、信用有關契約 (Credit Contracts)	4,200	0.04%	7,047	0.09%	-2,847	-40.40%
1. 信用違約交換(Credit Default Swap)	4,200	0.04%	7,047	0.09%	-2,847	-40.40%
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	9,903,783	100.00%	7,949,826	100.00%	1,953,957	24.58%

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。