

附表1

銀行衍生性金融商品交易量彙總表

97年10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)	476,801	986,930	1,463,731	15.80%
(一)店頭市場(OTC)	399,069	436,985	836,054	9.02%
1.遠期利率協議(FRA)	900	65,663	66,563	0.72%
2.換利(IRS)	325,927	351,195	677,122	7.31%
3.買入選擇權(Bought Options)	37,742	19,797	57,539	0.62%
4.賣出選擇權(Sold Options)	34,500	330	34,830	0.38%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	77,732	549,945	627,677	6.77%
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	39,079	331,819	370,898	4.00%
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	38,653	177,585	216,238	2.33%
3.買入選擇權(Bought Options)	-	20,048	20,048	0.22%
4.賣出選擇權(Sold Options)	-	20,493	20,493	0.22%
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	2,481,356	4,981,335	7,462,691	80.54%
(一)店頭市場(OTC)	2,481,356	4,981,335	7,462,691	80.54%
1.遠期契約(Outright Forwards)	724,817	1,175,944	1,900,761	20.51%
2.換匯(Fx Swaps)	1,590,174	3,289,116	4,879,290	52.66%
3.換匯換利(Currency Swaps)	105,694	7,780	113,474	1.22%
4.買入選擇權(Bought Options)	31,522	261,030	292,552	3.16%
5.賣出選擇權(Sold Options)	29,149	247,465	276,614	2.99%
(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)	252,348	12,357	264,705	2.86%
(一)店頭市場(OTC)	30	-	30	0.00%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	252,318	12,357	264,675	2.86%
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	26,474	40,083	66,557	0.72%
(一)店頭市場(OTC)	-	37,615	37,615	0.41%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	26,474	2,468	28,942	0.31%
小 計(一至四)	3,236,979	6,020,705	9,257,684	99.92%
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	7,706	7,706	0.08%
1.信用違約交換(Credit Default Swap)	-	7,706	7,706	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	3,236,979	6,028,411	9,265,390	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10月份

單位：新臺幣百萬元

商 品 種 類	97年10月		97年9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)	1,463,731	15.80%	2,559,841	26.27%	-1,096,110	-42.82%
(一)店頭市場(OTC)	836,054	9.02%	1,225,380	12.57%	-389,326	-31.77%
1. 遠期利率協議(FRA)	66,563	0.72%	28,907	0.30%	37,656	130.27%
2. 換利(IRS)	677,122	7.31%	1,116,245	11.45%	-439,123	-39.34%
3. 買入選擇權(Bought Options)	57,539	0.62%	50,257	0.51%	7,282	14.49%
4. 賣出選擇權(Sold Options)	34,830	0.38%	29,971	0.31%	4,859	16.21%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	627,677	6.77%	1,334,461	13.70%	-706,784	-52.96%
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	370,898	4.00%	608,272	6.24%	-237,374	-39.02%
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	216,238	2.33%	691,761	7.10%	-475,523	-68.74%
3. 買入選擇權(Bought Options)	20,048	0.22%	17,214	0.18%	2,834	16.46%
4. 賣出選擇權(Sold Options)	20,493	0.22%	17,214	0.18%	3,279	19.05%
二、匯率有關契約 (Foreign Exchange Transactions)	7,462,691	80.54%	6,731,112	69.08%	731,579	10.87%
(一)店頭市場(OTC)	7,462,691	80.54%	6,731,112	69.08%	731,579	10.87%
1. 遠期契約(Outright Forwards)	1,900,761	20.51%	1,664,638	17.08%	236,123	14.18%
2. 換匯(Fx Swaps)	4,879,290	52.66%	4,207,491	43.18%	671,799	15.97%
3. 換匯換利(Currency Swaps)	113,474	1.22%	101,553	1.04%	11,921	11.74%
4. 買入選擇權(Bought Options)	292,552	3.16%	392,229	4.03%	-99,677	-25.41%
5. 賣出選擇權(Sold Options)	276,614	2.99%	365,201	3.75%	-88,587	-24.26%
(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)	264,705	2.86%	347,530	3.57%	-82,825	-23.83%
(一)店頭市場(OTC)	30	0.00%	139	0.00%	-109	-78.42%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	264,675	2.86%	347,391	3.57%	-82,716	-23.81%
四、商品有關契約 (Commodity Contracts)	66,557	0.72%	97,374	1.00%	-30,817	-31.65%
(一)店頭市場(OTC)	37,615	0.41%	66,228	0.68%	-28,613	-43.20%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	28,942	0.31%	31,146	0.32%	-2,204	-7.08%
小 計(一至四)	9,257,684	99.92%	9,735,857	99.92%	-478,173	-4.91%
五、信用有關契約 (Credit Contracts)	7,706	0.08%	8,067	0.08%	-361	-4.48%
1. 信用違約交換(Credit Default Swap)	7,706	0.08%	8,067	0.08%	-361	-4.48%
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	9,265,390	100.00%	9,743,924	100.00%	-478,534	-4.91%

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。