

附表1

銀行衍生性金融商品交易量彙總表

97年5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, 118, 488	1, 500, 135	2, 618, 623	29. 34%
(一)店頭市場(OTC)	608, 765	409, 553	1, 018, 318	11. 41%
1. 遠期利率協議(FRA)	-	34, 215	34, 215	0. 38%
2. 換利(IRS)	524, 871	354, 164	879, 035	9. 85%
3. 買入選擇權(Bought Options)	39, 544	12, 072	51, 616	0. 58%
4. 賣出選擇權(Sold Options)	44, 350	9, 102	53, 452	0. 60%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	509, 723	1, 090, 582	1, 600, 305	17. 93%
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	263, 961	516, 813	780, 774	8. 75%
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	245, 762	543, 989	789, 751	8. 85%
3. 買入選擇權(Bought Options)	-	17, 931	17, 931	0. 20%
4. 賣出選擇權(Sold Options)	-	11, 849	11, 849	0. 13%
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	2, 276, 243	3, 648, 963	5, 925, 206	66. 37%
(一)店頭市場(OTC)	2, 276, 243	3, 648, 963	5, 925, 206	66. 37%
1. 遠期契約(Outright Forwards)	721, 224	549, 562	1, 270, 786	14. 23%
2. 換匯(Fx Swaps)	1, 353, 607	2, 215, 155	3, 568, 762	39. 98%
3. 換匯換利(Currency Swaps)	115, 614	7, 380	122, 994	1. 38%
4. 買入選擇權(Bought Options)	45, 114	430, 925	476, 039	5. 33%
5. 賣出選擇權(Sold Options)	40, 684	445, 941	486, 625	5. 45%
(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)	300, 899	7, 709	308, 608	3. 46%
(一)店頭市場(OTC)	110	-	110	0. 00%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	300, 789	7, 709	308, 498	3. 46%
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	27, 060	26, 850	53, 910	0. 60%
(一)店頭市場(OTC)	-	26, 754	26, 754	0. 30%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	27, 060	96	27, 156	0. 30%
小 計(一至四)	3, 722, 690	5, 183, 657	8, 906, 347	99. 77%
五、信用有關契約(Credit Contracts)	550	20, 127	20, 677	0. 23%
1. 信用違約交換(Credit Default Swap)	550	20, 127	20, 677	0. 23%
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, 723, 240	5, 203, 784	8, 927, 024	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5月份

單位：新臺幣百萬元

商 品 種 類	97年5月		97年4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)	2,618,623	29.34%	2,500,651	27.83%	117,972	4.72%
(一)店頭市場(OTC)	1,018,318	11.41%	1,117,516	12.44%	-99,198	-8.88%
1. 遠期利率協議(FRA)	34,215	0.38%	37,147	0.41%	-2,932	-7.89%
2. 換利(IRS)	879,035	9.85%	904,633	10.07%	-25,598	-2.83%
3. 買入選擇權(Bought Options)	51,616	0.58%	84,348	0.94%	-32,732	-38.81%
4. 賣出選擇權(Sold Options)	53,452	0.60%	91,388	1.02%	-37,936	-41.51%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	1,600,305	17.93%	1,383,135	15.39%	217,170	15.70%
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	780,774	8.75%	724,567	8.06%	56,207	7.76%
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	789,751	8.85%	658,568	7.33%	131,183	19.92%
3. 買入選擇權(Bought Options)	17,931	0.20%	-	-	17,931	-
4. 賣出選擇權(Sold Options)	11,849	0.13%	-	-	11,849	-
二、匯率有關契約 (Foreign Exchange Transactions)	5,925,206	66.37%	6,130,528	68.24%	-205,322	-3.35%
(一)店頭市場(OTC)	5,925,206	66.37%	6,130,528	68.24%	-205,322	-3.35%
1. 遠期契約(Outright Forwards)	1,270,786	14.23%	1,345,095	14.97%	-74,309	-5.52%
2. 換匯(Fx Swaps)	3,568,762	39.98%	3,758,939	41.84%	-190,177	-5.06%
3. 換匯換利(Currency Swaps)	122,994	1.38%	122,612	1.37%	382	0.31%
4. 買入選擇權(Bought Options)	476,039	5.33%	468,882	5.22%	7,157	1.53%
5. 賣出選擇權(Sold Options)	486,625	5.45%	435,000	4.84%	51,625	11.87%
(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)	308,608	3.46%	266,199	2.96%	42,409	15.93%
(一)店頭市場(OTC)	110	0.00%	1,089	0.01%	-979	-89.90%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	308,498	3.46%	265,110	2.95%	43,388	16.37%
四、商品有關契約 (Commodity Contracts)	53,910	0.60%	74,713	0.83%	-20,803	-27.84%
(一)店頭市場(OTC)	26,754	0.30%	44,040	0.49%	-17,286	-39.25%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	27,156	0.30%	30,673	0.34%	-3,517	-11.47%
小 計(一至四)	8,906,347	99.77%	8,972,091	99.86%	-65,744	-0.73%
五、信用有關契約 (Credit Contracts)	20,677	0.23%	12,065	0.14%	8,612	71.38%
1. 信用違約交換(Credit Default Swap)	20,677	0.23%	11,761	0.14%	8,916	75.81%
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	-100.00%
六、其他有關契約 (Other Contracts)	-	-	304	0.00%	-304	-100.00%
1. 遠期契約(Outright Forwards)	-	-	-	-	-	-
2. 交換(Swaps)	-	-	304	0.00%	-304	-100.00%
3. 選擇權(Options)	-	-	-	-	-	-
總 計	8,927,024	100.00%	8,984,460	100.00%	-57,436	-0.64%

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。