

附表1

銀行衍生性金融商品交易量彙總表

97年2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)	780,920	1,848,275	2,629,195	33.07%
(一)店頭市場(OTC)	504,638	707,165	1,211,803	15.24%
1.遠期利率協議(FRA)	5,500	140,382	145,882	1.83%
2.換利(IRS)	442,461	552,905	995,366	12.52%
3.買入選擇權(Bought Options)	28,224	324	28,548	0.36%
4.賣出選擇權(Sold Options)	28,453	13,554	42,007	0.53%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	276,282	1,141,110	1,417,392	17.83%
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	138,418	621,949	760,367	9.56%
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	137,864	515,151	653,015	8.21%
3.買入選擇權(Bought Options)	-	2,832	2,832	0.04%
4.賣出選擇權(Sold Options)	-	1,178	1,178	0.02%
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	1,915,895	3,217,013	5,132,908	64.57%
(一)店頭市場(OTC)	1,915,895	3,217,013	5,132,908	64.57%
1.遠期契約(Outright Forwards)	694,723	491,497	1,186,220	14.92%
2.換匯(Fx Swaps)	1,001,453	2,023,811	3,025,264	38.06%
3.換匯換利(Currency Swaps)	74,498	42	74,540	0.94%
4.買入選擇權(Bought Options)	77,530	360,786	438,316	5.51%
5.賣出選擇權(Sold Options)	67,691	340,877	408,568	5.14%
(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)	156,650	7,836	164,486	2.07%
(一)店頭市場(OTC)	41	16	57	0.00%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	156,609	7,820	164,429	2.07%
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	-	16,190	16,190	0.20%
(一)店頭市場(OTC)	-	16,190	16,190	0.20%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	-	-	-
小 計(一至四)	2,853,465	5,089,314	7,942,779	99.91%
五、信用有關契約(Credit Contracts)	1,760	5,287	7,047	0.09%
1.信用違約交換(Credit Default Swap)	1,760	5,287	7,047	0.09%
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	2,855,225	5,094,601	7,949,826	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。

附表2

銀行衍生性金融商品交易量比較表

97年2月份

單位：新臺幣百萬元

商 品 種 類	97年2月		97年1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)	2,629,195	33.07%	3,535,101	33.66%	-905,906	-25.63%
(一)店頭市場(OTC)	1,211,803	15.24%	1,322,166	12.59%	-110,363	-8.35%
1.遠期利率協議(FRA)	145,882	1.83%	109,398	1.04%	36,484	33.35%
2.換利(IRS)	995,366	12.52%	935,553	8.91%	59,813	6.39%
3.買入選擇權(Bought Options)	28,548	0.36%	157,391	1.50%	-128,843	-81.86%
4.賣出選擇權(Sold Options)	42,007	0.53%	119,824	1.14%	-77,817	-64.94%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	1,417,392	17.83%	2,212,935	21.07%	-795,543	-35.95%
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	760,367	9.56%	1,038,564	9.89%	-278,197	-26.79%
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	653,015	8.21%	1,123,517	10.70%	-470,502	-41.88%
3.買入選擇權(Bought Options)	2,832	0.04%	28,122	0.27%	-25,290	-89.93%
4.賣出選擇權(Sold Options)	1,178	0.02%	22,732	0.21%	-21,554	-94.82%
二、匯率有關契約 (Foreign Exchange Transactions)	5,132,908	64.57%	6,497,490	61.87%	-1,364,582	-21.00%
(一)店頭市場(OTC)	5,132,908	64.57%	6,497,490	61.87%	-1,364,582	-21.00%
1.遠期契約(Outright Forwards)	1,186,220	14.92%	1,370,052	13.05%	-183,832	-13.42%
2.換匯(Fx Swaps)	3,025,264	38.06%	4,051,051	38.57%	-1,025,787	-25.32%
3.換匯換利(Currency Swaps)	74,540	0.94%	141,795	1.35%	-67,255	-47.43%
4.買入選擇權(Bought Options)	438,316	5.51%	481,302	4.58%	-42,986	-8.93%
5.賣出選擇權(Sold Options)	408,568	5.14%	453,290	4.32%	-44,722	-9.87%
(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)	164,486	2.07%	403,167	3.83%	-238,681	-59.20%
(一)店頭市場(OTC)	57	0.00%	2,577	0.02%	-2,520	-97.79%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	164,429	2.07%	400,590	3.81%	-236,161	-58.95%
四、商品有關契約 (Commodity Contracts)	16,190	0.20%	59,553	0.57%	-43,363	-72.81%
(一)店頭市場(OTC)	16,190	0.20%	59,553	0.57%	-43,363	-72.81%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	-	-	-	-	-
小 計(一至四)	7,942,779	99.91%	10,495,311	99.93%	-2,552,532	-24.32%
五、信用有關契約 (Credit Contracts)	7,047	0.09%	7,273	0.07%	-226	-3.11%
1.信用違約交換(Credit Default Swap)	7,047	0.09%	7,273	0.07%	-226	-3.11%
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	7,949,826	100.00%	10,502,584	100.00%	-2,552,758	-24.31%

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。