

銀行衍生性金融商品交易量彙總表

98年9月份

附表1

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)	693,638	1,571,395	2,265,033	24.91%
(一)店頭市場(OTC)	606,341	1,123,661	1,730,002	19.03%
1.遠期利率協議(FRA)	-	6,440	6,440	0.07%
2.換利(IRS)	559,031	1,095,779	1,654,810	18.20%
3.買入選擇權(Bought Options)	22,175	21,229	43,404	0.48%
4.賣出選擇權(Sold Options)	25,135	213	25,348	0.28%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	87,297	447,734	535,031	5.88%
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	43,697	217,825	261,522	2.87%
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	43,600	204,333	247,933	2.73%
3.買入選擇權(Bought Options)	-	13,805	13,805	0.15%
4.賣出選擇權(Sold Options)	-	11,771	11,771	0.13%
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	2,955,259	3,497,132	6,452,391	70.99%
(一)店頭市場(OTC)	2,955,259	3,497,132	6,452,391	70.99%
1.遠期契約(Outright Forwards)	487,254	369,844	857,098	9.43%
2.換匯(Fx Swaps)	2,261,800	2,117,537	4,379,337	48.18%
3.換匯換利(Currency Swaps)	74,204	3,632	77,836	0.86%
4.買入選擇權(Bought Options)	67,348	507,040	574,388	6.32%
5.賣出選擇權(Sold Options)	64,653	499,079	563,732	6.20%
(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)	265,834	4,600	270,434	2.98%
(一)店頭市場(OTC)	372	366	738	0.01%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	265,462	4,234	269,696	2.97%
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	38,192	49,691	87,883	0.97%
(一)店頭市場(OTC)	-	47,190	47,190	0.52%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	38,192	2,501	40,693	0.45%
小 計(一至四)	3,952,923	5,122,818	9,075,741	99.85%
五、信用有關契約(Credit Contracts)	57	13,457	13,514	0.15%
1.信用違約交換(Credit Default Swap)	57	13,457	13,514	0.15%
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	3,952,980	5,136,275	9,089,255	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

98年9月份

單位：新臺幣百萬元

商 品 種 類	98年9月		98年8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)	2,265,033	24.91%	3,453,717	36.29%	-1,188,684	-34.42%
(一)店頭市場(OTC)	1,730,002	19.03%	2,772,001	29.13%	-1,041,999	-37.59%
1.遠期利率協議(FRA)	6,440	0.07%	5,268	0.06%	1,172	22.25%
2.換利(IRS)	1,654,810	18.20%	2,696,639	28.33%	-1,041,829	-38.63%
3.買入選擇權(Bought Options)	43,404	0.48%	46,331	0.49%	-2,927	-6.32%
4.賣出選擇權(Sold Options)	25,348	0.28%	23,763	0.25%	1,585	6.67%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	535,031	5.88%	681,716	7.16%	-146,685	-21.52%
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	261,522	2.87%	315,853	3.32%	-54,331	-17.20%
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	247,933	2.73%	336,947	3.54%	-89,014	-26.42%
3.買入選擇權(Bought Options)	13,805	0.15%	13,428	0.14%	377	2.81%
4.賣出選擇權(Sold Options)	11,771	0.13%	15,488	0.16%	-3,717	-24.00%
二、匯率有關契約 (Foreign Exchange Transactions)	6,452,391	70.99%	5,749,648	60.41%	702,743	12.22%
(一)店頭市場(OTC)	6,452,391	70.99%	5,749,648	60.41%	702,743	12.22%
1.遠期契約(Outright Forwards)	857,098	9.43%	774,111	8.13%	82,987	10.72%
2.換匯(Fx Swaps)	4,379,337	48.18%	3,911,229	41.10%	468,108	11.97%
3.換匯換利(Currency Swaps)	77,836	0.86%	64,558	0.68%	13,278	20.57%
4.買入選擇權(Bought Options)	574,388	6.32%	501,971	5.27%	72,417	14.43%
5.賣出選擇權(Sold Options)	563,732	6.20%	497,779	5.23%	65,953	13.25%
(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)	270,434	2.98%	217,678	2.29%	52,756	24.24%
(一)店頭市場(OTC)	738	0.01%	478	0.01%	260	54.39%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	269,696	2.97%	217,200	2.28%	52,496	24.17%
四、商品有關契約 (Commodity Contracts)	87,883	0.97%	85,394	0.90%	2,489	2.91%
(一)店頭市場(OTC)	47,190	0.52%	47,581	0.50%	-391	-0.82%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	40,693	0.45%	37,813	0.40%	2,880	7.62%
小 計(一至四)	9,075,741	99.85%	9,506,437	99.89%	-430,696	-4.53%
五、信用有關契約 (Credit Contracts)	13,514	0.15%	10,569	0.11%	2,945	27.86%
1.信用違約交換(Credit Default Swap)	13,514	0.15%	10,569	0.11%	2,945	27.86%
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	9,089,255	100.00%	9,517,006	100.00%	-427,751	-4.49%

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。