

銀行衍生性金融商品交易量彙總表

98年1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
<b>一、利率有關契約(Interest Rate Contracts)</b>	<b>472,387</b>	<b>1,871,997</b>	<b>2,344,384</b>	<b>36.27%</b>
(一)店頭市場(OTC)	392,855	1,218,400	1,611,255	24.93%
1.遠期利率協議(FRA)	-	57,205	57,205	0.89%
2.換利(IRS)	364,040	1,145,341	1,509,381	23.35%
3.買入選擇權(Bought Options)	15,204	15,094	30,298	0.47%
4.賣出選擇權(Sold Options)	13,611	760	14,371	0.22%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	79,532	653,597	733,129	11.34%
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	39,644	299,082	338,726	5.24%
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	39,888	285,396	325,284	5.03%
3.買入選擇權(Bought Options)	-	68,161	68,161	1.06%
4.賣出選擇權(Sold Options)	-	958	958	0.01%
<b>二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)</b>	<b>1,678,583</b>	<b>2,192,889</b>	<b>3,871,472</b>	<b>59.89%</b>
(一)店頭市場(OTC)	1,678,583	2,192,889	3,871,472	59.89%
1.遠期契約(Outright Forwards)	439,375	295,327	734,702	11.37%
2.換匯(Fx Swaps)	1,138,042	1,478,014	2,616,056	40.47%
3.換匯換利(Currency Swaps)	54,650	2,449	57,099	0.88%
4.買入選擇權(Bought Options)	25,519	204,190	229,709	3.55%
5.賣出選擇權(Sold Options)	20,997	212,909	233,906	3.62%
(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)	-	-	-	-
<b>三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)</b>	<b>138,560</b>	<b>3,640</b>	<b>142,200</b>	<b>2.20%</b>
(一)店頭市場(OTC)	229	14	243	0.00%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	138,331	3,626	141,957	2.20%
<b>四、商品有關契約(Commodity Contracts)</b>	<b>57,245</b>	<b>42,496</b>	<b>99,741</b>	<b>1.54%</b>
(一)店頭市場(OTC)	-	41,610	41,610	0.64%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	57,245	886	58,131	0.90%
<b>小 計(一至四)</b>	<b>2,346,775</b>	<b>4,111,022</b>	<b>6,457,797</b>	<b>99.90%</b>
<b>五、信用有關契約(Credit Contracts)</b>	<b>-</b>	<b>6,433</b>	<b>6,433</b>	<b>0.10%</b>
1.信用違約交換(Credit Default Swap)	-	6,433	6,433	0.10%
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)	-	-	-	-
<b>六、其他有關契約(Other Contracts)</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>
1.遠期契約(Outright Forwards)	-	-	-	-
2.交換(Swaps)	-	-	-	-
3.選擇權(Options)	-	-	-	-
<b>總 計</b>	<b>2,346,775</b>	<b>4,117,455</b>	<b>6,464,230</b>	<b>100.00%</b>

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1月份

單位：新臺幣百萬元

商品種類	98年1月		97年12月		比較增減	
	合計	百分比	合計	百分比	合計	百分比
<b>一、利率有關契約(Interest Rate Contracts)</b>	2,344,384	36.27%	1,901,783	27.61%	442,601	23.27%
(一)店頭市場(OTC)	1,611,255	24.93%	1,339,899	19.45%	271,356	20.25%
1. 遠期利率協議(FRA)	57,205	0.89%	62,207	0.90%	-5,002	-8.04%
2. 換利(IRS)	1,509,381	23.35%	1,195,251	17.35%	314,130	26.28%
3. 買入選擇權(Bought Options)	30,298	0.47%	27,066	0.39%	3,232	11.94%
4. 賣出選擇權(Sold Options)	14,371	0.22%	55,375	0.81%	-41,004	-74.05%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	733,129	11.34%	561,884	8.16%	171,245	30.48%
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	338,726	5.24%	277,901	4.04%	60,825	21.89%
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	325,284	5.03%	283,983	4.12%	41,301	14.54%
3. 買入選擇權(Bought Options)	68,161	1.06%	-	-	68,161	-
4. 賣出選擇權(Sold Options)	958	0.01%	-	-	958	-
<b>二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)</b>	3,871,472	59.89%	4,634,432	67.28%	-762,960	-16.46%
(一)店頭市場(OTC)	3,871,472	59.89%	4,634,432	67.28%	-762,960	-16.46%
1. 遠期契約(Outright Forwards)	734,702	11.37%	809,219	11.75%	-74,517	-9.21%
2. 換匯(Fx Swaps)	2,616,056	40.47%	3,350,145	48.63%	-734,089	-21.91%
3. 換匯換利(Currency Swaps)	57,099	0.88%	40,439	0.59%	16,660	41.20%
4. 買入選擇權(Bought Options)	229,709	3.55%	224,454	3.26%	5,255	2.34%
5. 賣出選擇權(Sold Options)	233,906	3.62%	210,175	3.05%	23,731	11.29%
(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)	-	-	-	-	-	-
<b>三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)</b>	142,200	2.20%	202,594	2.94%	-60,395	-29.81%
(一)店頭市場(OTC)	243	0.00%	-	-	243	-
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	141,957	2.20%	202,594	2.94%	-60,638	-29.93%
<b>四、商品有關契約(Commodity Contracts)</b>	99,741	1.54%	146,106	2.12%	-46,365	-31.73%
(一)店頭市場(OTC)	41,610	0.64%	118,991	1.73%	-77,381	-65.03%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	58,131	0.90%	27,115	0.39%	31,016	114.39%
<b>小計(一至四)</b>	6,457,797	99.90%	6,884,915	99.95%	-427,119	-6.20%
<b>五、信用有關契約(Credit Contracts)</b>	6,433	0.10%	3,709	0.05%	2,724	73.44%
1. 信用違約交換(Credit Default Swap)	6,433	0.10%	3,709	0.05%	2,724	73.44%
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)	-	-	-	-	-	-
<b>六、其他有關契約(Other Contracts)</b>	-	-	-	-	-	-
1. 遠期契約(Outright Forwards)	-	-	-	-	-	-
2. 交換(Swaps)	-	-	-	-	-	-
3. 選擇權(Options)	-	-	-	-	-	-
<b>總計</b>	6,464,230	100.00%	6,888,624	100.00%	-424,395	-6.16%

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。