

銀行衍生性金融商品交易量彙總表

98年3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)	605,393	2,959,677	3,565,070	38.29%
(一)店頭市場(OTC)	526,415	1,784,594	2,311,009	24.82%
1.遠期利率協議(FRA)	-	24,759	24,759	0.26%
2.換利(IRS)	444,080	1,738,332	2,182,412	23.44%
3.買入選擇權(Bought Options)	43,878	19,205	63,083	0.68%
4.賣出選擇權(Sold Options)	38,457	2,298	40,755	0.44%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	78,978	1,175,083	1,254,061	13.47%
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	39,489	593,750	633,239	6.80%
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	39,489	581,333	620,822	6.67%
3.買入選擇權(Bought Options)	-	-	-	-
4.賣出選擇權(Sold Options)	-	-	-	-
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	2,570,197	2,759,890	5,330,087	57.24%
(一)店頭市場(OTC)	2,570,197	2,759,890	5,330,087	57.24%
1.遠期契約(Outright Forwards)	543,296	299,032	842,328	9.05%
2.換匯(Fx Swaps)	1,890,226	1,800,017	3,690,243	39.63%
3.換匯換利(Currency Swaps)	59,774	4,659	64,433	0.69%
4.買入選擇權(Bought Options)	37,164	326,678	363,842	3.91%
5.賣出選擇權(Sold Options)	39,737	329,504	369,241	3.96%
(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)	205,945	3,995	209,940	2.25%
(一)店頭市場(OTC)	132	146	278	0.00%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	205,813	3,849	209,662	2.25%
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	90,881	105,310	196,191	2.11%
(一)店頭市場(OTC)	-	103,777	103,777	1.12%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	90,881	1,533	92,414	0.99%
小 計(一至四)	3,472,416	5,828,872	9,301,288	99.89%
五、信用有關契約(Credit Contracts)	800	9,431	10,231	0.11%
1.信用違約交換(Credit Default Swap)	800	9,431	10,231	0.11%
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	3,473,216	5,838,303	9,311,519	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3月份

單位：新臺幣百萬元

商 品 種 類	98年3月		98年2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)	3,565,070	38.29%	3,124,378	37.23%	440,692	14.10%
(一)店頭市場(OTC)	2,311,009	24.82%	2,041,153	24.32%	269,856	13.22%
1. 遠期利率協議(FRA)	24,759	0.26%	17,475	0.21%	7,284	41.68%
2. 換利(IRS)	2,182,412	23.44%	1,952,499	23.26%	229,913	11.78%
3. 買入選擇權(Bought Options)	63,083	0.68%	44,036	0.53%	19,047	43.25%
4. 賣出選擇權(Sold Options)	40,755	0.44%	27,143	0.32%	13,612	50.15%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	1,254,061	13.47%	1,083,225	12.91%	170,836	15.77%
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	633,239	6.80%	525,715	6.26%	107,524	20.45%
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	620,822	6.67%	516,053	6.15%	104,769	20.30%
3. 買入選擇權(Bought Options)	-	-	23,410	0.28%	-23,410	-100.00%
4. 賣出選擇權(Sold Options)	-	-	18,047	0.22%	-18,047	-100.00%
二、匯率有關契約 (Foreign Exchange Transactions)	5,330,087	57.24%	4,966,324	59.16%	363,763	7.32%
(一)店頭市場(OTC)	5,330,087	57.24%	4,966,324	59.16%	363,763	7.32%
1. 遠期契約(Outright Forwards)	842,328	9.05%	759,168	9.04%	83,160	10.95%
2. 換匯(Fx Swaps)	3,690,243	39.63%	3,469,680	41.34%	220,563	6.36%
3. 換匯換利(Currency Swaps)	64,433	0.69%	75,894	0.90%	-11,461	-15.10%
4. 買入選擇權(Bought Options)	363,842	3.91%	338,311	4.03%	25,531	7.55%
5. 賣出選擇權(Sold Options)	369,241	3.96%	323,271	3.85%	45,970	14.22%
(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)	209,940	2.25%	183,318	2.18%	26,622	14.52%
(一)店頭市場(OTC)	278	0.00%	142	0.00%	136	95.77%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	209,662	2.25%	183,176	2.18%	26,486	14.46%
四、商品有關契約 (Commodity Contracts)	196,191	2.11%	115,714	1.38%	80,477	69.55%
(一)店頭市場(OTC)	103,777	1.12%	20,788	0.25%	82,989	399.22%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	92,414	0.99%	94,926	1.13%	-2,512	-2.65%
小 計(一至四)	9,301,288	99.89%	8,389,734	99.95%	911,554	10.87%
五、信用有關契約 (Credit Contracts)	10,231	0.11%	3,869	0.05%	6,362	164.44%
1. 信用違約交換(Credit Default Swap)	10,231	0.11%	3,869	0.05%	6,362	164.44%
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)	-	-	-	-	-	-
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	9,311,519	100.00%	8,393,603	100.00%	917,916	10.94%

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。