

銀行衍生性金融商品交易量彙總表

98年10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)	753,782	1,101,400	1,855,182	20.84%
(一)店頭市場(OTC)	675,734	320,886	996,620	11.20%
1.遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-
2.換利(IRS)	623,000	309,240	932,240	10.47%
3.買入選擇權(Bought Options)	26,591	9,275	35,866	0.41%
4.賣出選擇權(Sold Options)	26,143	2,371	28,514	0.32%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	78,048	780,514	858,562	9.64%
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	39,024	372,441	411,465	4.62%
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	39,024	395,624	434,648	4.88%
3.買入選擇權(Bought Options)	-	7,223	7,223	0.08%
4.賣出選擇權(Sold Options)	-	5,226	5,226	0.06%
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	3,082,808	3,596,410	6,679,218	75.02%
(一)店頭市場(OTC)	3,082,808	3,596,410	6,679,218	75.02%
1.遠期契約(Outright Forwards)	444,097	397,906	842,003	9.46%
2.換匯(Fx Swaps)	2,443,859	2,200,076	4,643,935	52.16%
3.換匯換利(Currency Swaps)	54,655	2,252	56,907	0.64%
4.買入選擇權(Bought Options)	71,755	492,985	564,740	6.34%
5.賣出選擇權(Sold Options)	68,442	503,191	571,633	6.42%
(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)	250,180	2,458	252,638	2.84%
(一)店頭市場(OTC)	294	-	294	0.00%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	249,886	2,458	252,344	2.84%
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	40,817	51,663	92,480	1.04%
(一)店頭市場(OTC)	-	49,119	49,119	0.55%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	40,817	2,544	43,361	0.49%
小 計(一至四)	4,127,587	4,751,931	8,879,518	99.74%
五、信用有關契約(Credit Contracts)	470	22,807	23,277	0.26%
1.信用違約交換(Credit Default Swap)	470	22,807	23,277	0.26%
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	4,128,057	4,774,738	8,902,795	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10月份

單位：新臺幣百萬元

商 品 種 類	98年10月		98年9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)	1,855,182	20.84%	2,265,033	24.91%	-409,851	-18.09%
(一)店頭市場(OTC)	996,620	11.20%	1,730,002	19.03%	-733,382	-42.39%
1. 遠期利率協議(FRA)	-	-	6,440	0.07%	-6,440	-100.00%
2. 換利(IRS)	932,240	10.47%	1,654,810	18.20%	-722,570	-43.66%
3. 買入選擇權(Bought Options)	35,866	0.41%	43,404	0.48%	-7,538	-17.37%
4. 賣出選擇權(Sold Options)	28,514	0.32%	25,348	0.28%	3,166	12.49%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	858,562	9.64%	535,031	5.88%	323,531	60.47%
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	411,465	4.62%	261,522	2.87%	149,943	57.33%
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	434,648	4.88%	247,933	2.73%	186,715	75.31%
3. 買入選擇權(Bought Options)	7,223	0.08%	13,805	0.15%	-6,582	-47.68%
4. 賣出選擇權(Sold Options)	5,226	0.06%	11,771	0.13%	-6,545	-55.60%
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	6,679,218	75.02%	6,452,391	70.99%	226,827	3.52%
(一)店頭市場(OTC)	6,679,218	75.02%	6,452,391	70.99%	226,827	3.52%
1. 遠期契約(Outright Forwards)	842,003	9.46%	857,098	9.43%	-15,095	-1.76%
2. 換匯(Fx Swaps)	4,643,935	52.16%	4,379,337	48.18%	264,598	6.04%
3. 換匯換利(Currency Swaps)	56,907	0.64%	77,836	0.86%	-20,929	-26.89%
4. 買入選擇權(Bought Options)	564,740	6.34%	574,388	6.32%	-9,648	-1.68%
5. 賣出選擇權(Sold Options)	571,633	6.42%	563,732	6.20%	7,901	1.40%
(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)	252,638	2.84%	270,434	2.98%	-17,796	-6.58%
(一)店頭市場(OTC)	294	0.00%	738	0.01%	-444	-60.16%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	252,344	2.84%	269,696	2.97%	-17,352	-6.43%
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	92,480	1.04%	87,883	0.97%	4,597	5.23%
(一)店頭市場(OTC)	49,119	0.55%	47,190	0.52%	1,929	4.09%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	43,361	0.49%	40,693	0.45%	2,668	6.56%
小 計(一至四)	8,879,518	99.74%	9,075,741	99.85%	-196,223	-2.16%
五、信用有關契約(Credit Contracts)	23,277	0.26%	13,514	0.15%	9,763	72.24%
1. 信用違約交換(Credit Default Swap)	23,277	0.26%	13,514	0.15%	9,763	72.24%
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	8,902,795	100.00%	9,089,255	100.00%	-186,460	-2.05%

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。