

銀行衍生性金融商品交易量彙總表

98年4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)	582,730	2,315,942	2,898,672	33.66%
(一)店頭市場(OTC)	504,556	1,575,256	2,079,812	24.15%
1.遠期利率協議(FRA)	-	18,767	18,767	0.22%
2.換利(IRS)	472,120	1,554,610	2,026,730	23.53%
3.買入選擇權(Bought Options)	14,829	-	14,829	0.17%
4.賣出選擇權(Sold Options)	17,607	1,879	19,486	0.23%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	78,174	740,686	818,860	9.51%
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	39,084	367,310	406,394	4.72%
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	39,090	368,926	408,016	4.73%
3.買入選擇權(Bought Options)	-	2,225	2,225	0.03%
4.賣出選擇權(Sold Options)	-	2,225	2,225	0.03%
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	2,564,472	2,726,326	5,290,798	61.43%
(一)店頭市場(OTC)	2,564,472	2,726,326	5,290,798	61.43%
1.遠期契約(Outright Forwards)	537,500	305,280	842,780	9.78%
2.換匯(Fx Swaps)	1,882,892	1,835,946	3,718,838	43.18%
3.換匯換利(Currency Swaps)	57,458	1,926	59,384	0.69%
4.買入選擇權(Bought Options)	50,975	290,683	341,658	3.97%
5.賣出選擇權(Sold Options)	35,647	292,491	328,138	3.81%
(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)	217,968	8,733	226,701	2.63%
(一)店頭市場(OTC)	126	76	202	0.00%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	217,842	8,657	226,499	2.63%
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	93,916	97,875	191,791	2.23%
(一)店頭市場(OTC)	-	96,905	96,905	1.13%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	93,916	970	94,886	1.10%
小 計(一至四)	3,459,086	5,148,876	8,607,962	99.95%
五、信用有關契約(Credit Contracts)	960	3,668	4,628	0.05%
1.信用違約交換(Credit Default Swap)	960	3,668	4,628	0.05%
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	3,460,046	5,152,544	8,612,590	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4月份

單位：新臺幣百萬元

商 品 種 類	98年4月		98年3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)	2,898,672	33.66%	3,565,070	38.29%	-666,398	-18.69%
(一)店頭市場(OTC)	2,079,812	24.15%	2,311,009	24.82%	-231,197	-10.00%
1. 遠期利率協議(FRA)	18,767	0.22%	24,759	0.26%	-5,992	-24.20%
2. 換利(IRS)	2,026,730	23.53%	2,182,412	23.44%	-155,682	-7.13%
3. 買入選擇權(Bought Options)	14,829	0.17%	63,083	0.68%	-48,254	-76.49%
4. 賣出選擇權(Sold Options)	19,486	0.23%	40,755	0.44%	-21,269	-52.19%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	818,860	9.51%	1,254,061	13.47%	-435,201	-34.70%
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	406,394	4.72%	633,239	6.80%	-226,845	-35.82%
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	408,016	4.73%	620,822	6.67%	-212,806	-34.28%
3. 買入選擇權(Bought Options)	2,225	0.03%	-	-	2,225	-
4. 賣出選擇權(Sold Options)	2,225	0.03%	-	-	2,225	-
二、匯率有關契約 (Foreign Exchange Transactions)	5,290,798	61.43%	5,330,087	57.24%	-39,289	-0.74%
(一)店頭市場(OTC)	5,290,798	61.43%	5,330,087	57.24%	-39,289	-0.74%
1. 遠期契約(Outright Forwards)	842,780	9.78%	842,328	9.05%	452	0.05%
2. 換匯(Fx Swaps)	3,718,838	43.18%	3,690,243	39.63%	28,595	0.77%
3. 換匯換利(Currency Swaps)	59,384	0.69%	64,433	0.69%	-5,049	-7.84%
4. 買入選擇權(Bought Options)	341,658	3.97%	363,842	3.91%	-22,184	-6.10%
5. 賣出選擇權(Sold Options)	328,138	3.81%	369,241	3.96%	-41,103	-11.13%
(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)	226,701	2.63%	209,940	2.25%	16,761	7.98%
(一)店頭市場(OTC)	202	0.00%	278	0.00%	-76	-27.34%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	226,499	2.63%	209,662	2.25%	16,837	8.03%
四、商品有關契約 (Commodity Contracts)	191,791	2.23%	196,191	2.11%	-4,400	-2.24%
(一)店頭市場(OTC)	96,905	1.13%	103,777	1.12%	-6,872	-6.62%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	94,886	1.10%	92,414	0.99%	2,472	2.67%
小 計(一至四)	8,607,962	99.95%	9,301,288	99.89%	-693,326	-7.45%
五、信用有關契約 (Credit Contracts)	4,628	0.05%	10,231	0.11%	-5,603	-54.76%
1. 信用違約交換(Credit Default Swap)	4,628	0.05%	10,231	0.11%	-5,603	-54.76%
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	8,612,590	100.00%	9,311,519	100.00%	-698,929	-7.51%

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。