

銀行衍生性金融商品交易量彙總表

98年7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)	611,678	2,643,435	3,255,113	34.83%
(一)店頭市場(OTC)	531,954	1,964,103	2,496,057	26.71%
1.遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-
2.換利(IRS)	458,991	1,954,064	2,413,055	25.82%
3.買入選擇權(Bought Options)	33,960	4,529	38,489	0.41%
4.賣出選擇權(Sold Options)	39,003	5,510	44,513	0.48%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	79,724	679,332	759,056	8.12%
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	39,862	321,193	361,055	3.86%
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	39,862	330,218	370,080	3.96%
3.買入選擇權(Bought Options)	-	16,389	16,389	0.18%
4.賣出選擇權(Sold Options)	-	11,532	11,532	0.12%
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	2,711,971	3,018,576	5,730,547	61.32%
(一)店頭市場(OTC)	2,711,971	3,018,576	5,730,547	61.32%
1.遠期契約(Outright Forwards)	471,372	307,814	779,186	8.34%
2.換匯(Fx Swaps)	2,094,676	1,877,267	3,971,943	42.50%
3.換匯換利(Currency Swaps)	69,432	1,933	71,365	0.76%
4.買入選擇權(Bought Options)	41,369	417,663	459,032	4.91%
5.賣出選擇權(Sold Options)	35,122	413,899	449,021	4.81%
(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)	231,742	5,807	237,549	2.54%
(一)店頭市場(OTC)	302	-	302	0.00%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	231,440	5,807	237,247	2.54%
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	37,137	70,990	108,127	1.16%
(一)店頭市場(OTC)	-	70,212	70,212	0.75%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	37,137	778	37,915	0.41%
小 計(一至四)	3,592,528	5,738,808	9,331,336	99.85%
五、信用有關契約(Credit Contracts)	445	13,274	13,719	0.15%
1.信用違約交換(Credit Default Swap)	445	13,274	13,719	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	3,592,973	5,752,082	9,345,055	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7月份

單位：新臺幣百萬元

商 品 種 類	98年7月		98年6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)	3,255,113	34.83%	3,522,238	36.83%	-267,125	-7.58%
(一)店頭市場(OTC)	2,496,057	26.71%	2,565,062	26.83%	-69,005	-2.69%
1.遠期利率協議(FRA)	-	-	33,476	0.35%	-33,476	-100.00%
2.換利(IRS)	2,413,055	25.82%	2,467,910	25.81%	-54,855	-2.22%
3.買入選擇權(Bought Options)	38,489	0.41%	37,010	0.39%	1,479	4.00%
4.賣出選擇權(Sold Options)	44,513	0.48%	26,666	0.28%	17,847	66.93%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	759,056	8.12%	957,176	10.00%	-198,120	-20.70%
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	361,055	3.86%	479,259	5.01%	-118,204	-24.66%
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	370,080	3.96%	474,678	4.96%	-104,598	-22.04%
3.買入選擇權(Bought Options)	16,389	0.18%	-	-	16,389	-
4.賣出選擇權(Sold Options)	11,532	0.12%	3,239	0.03%	8,293	256.04%
二、匯率有關契約 (Foreign Exchange Transactions)	5,730,547	61.32%	5,706,837	59.67%	23,710	0.42%
(一)店頭市場(OTC)	5,730,547	61.32%	5,706,837	59.67%	23,710	0.42%
1.遠期契約(Outright Forwards)	779,186	8.34%	757,589	7.92%	21,597	2.85%
2.換匯(Fx Swaps)	3,971,943	42.50%	4,005,819	41.89%	-33,876	-0.85%
3.換匯換利(Currency Swaps)	71,365	0.76%	77,759	0.81%	-6,394	-8.22%
4.買入選擇權(Bought Options)	459,032	4.91%	439,221	4.59%	19,811	4.51%
5.賣出選擇權(Sold Options)	449,021	4.81%	426,449	4.46%	22,572	5.29%
(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)	-	-	-	-	-	-
三、權益證券有關契約 (Equity-linked Contracts)	237,549	2.54%	233,389	2.44%	4,160	1.78%
(一)店頭市場(OTC)	302	0.00%	380	0.00%	-78	-20.53%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	237,247	2.54%	233,009	2.44%	4,238	1.82%
四、商品有關契約 (Commodity Contracts)	108,127	1.16%	97,020	1.02%	11,107	11.45%
(一)店頭市場(OTC)	70,212	0.75%	58,122	0.61%	12,090	20.80%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	37,915	0.41%	38,898	0.41%	-983	-2.53%
小 計(一至四)	9,331,336	99.85%	9,559,484	99.96%	-228,148	-2.39%
五、信用有關契約 (Credit Contracts)	13,719	0.15%	3,823	0.04%	9,896	258.85%
1.信用違約交換(Credit Default Swap)	13,719	0.15%	3,823	0.04%	9,896	258.85%
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	9,345,055	100.00%	9,563,307	100.00%	-218,252	-2.28%

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。