

銀行衍生性金融商品交易量彙總表

98年5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)	419,035	2,445,175	2,864,210	34.66%
(一)店頭市場(OTC)	384,203	1,687,957	2,072,160	25.08%
1.遠期利率協議(FRA)	-	27,426	27,426	0.33%
2.換利(IRS)	355,228	1,657,452	2,012,680	24.36%
3.買入選擇權(Bought Options)	13,189	784	13,973	0.17%
4.賣出選擇權(Sold Options)	15,786	2,295	18,081	0.22%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	34,832	757,218	792,050	9.58%
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	17,554	372,967	390,521	4.72%
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	17,278	379,354	396,632	4.80%
3.買入選擇權(Bought Options)	-	3,265	3,265	0.04%
4.賣出選擇權(Sold Options)	-	1,632	1,632	0.02%
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	2,739,303	2,345,611	5,084,914	61.54%
(一)店頭市場(OTC)	2,739,303	2,345,611	5,084,914	61.54%
1.遠期契約(Outright Forwards)	472,101	310,587	782,688	9.47%
2.換匯(Fx Swaps)	1,989,877	1,487,741	3,477,618	42.09%
3.換匯換利(Currency Swaps)	111,469	1,922	113,391	1.37%
4.買入選擇權(Bought Options)	80,582	273,142	353,724	4.28%
5.賣出選擇權(Sold Options)	85,274	272,219	357,493	4.33%
(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)	204,094	5,080	209,174	2.53%
(一)店頭市場(OTC)	177	-	177	0.00%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	203,917	5,080	208,997	2.53%
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	37,287	62,380	99,667	1.21%
(一)店頭市場(OTC)	-	61,599	61,599	0.75%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	37,287	781	38,068	0.46%
小 計(一至四)	3,399,719	4,858,246	8,257,965	99.94%
五、信用有關契約(Credit Contracts)	55	4,703	4,758	0.06%
1.信用違約交換(Credit Default Swap)	55	4,703	4,758	0.06%
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	3,399,774	4,862,949	8,262,723	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5月份

單位：新臺幣百萬元

商 品 種 類	98年5月		98年4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)	2,864,210	34.66%	2,898,672	33.66%	-34,462	-1.19%
(一)店頭市場(OTC)	2,072,160	25.08%	2,079,812	24.15%	-7,652	-0.37%
1.遠期利率協議(FRA)	27,426	0.33%	18,767	0.22%	8,659	46.14%
2.換利(IRS)	2,012,680	24.36%	2,026,730	23.53%	-14,050	-0.69%
3.買入選擇權(Bought Options)	13,973	0.17%	14,829	0.17%	-856	-5.77%
4.賣出選擇權(Sold Options)	18,081	0.22%	19,486	0.23%	-1,405	-7.21%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	792,050	9.58%	818,860	9.51%	-26,810	-3.27%
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	390,521	4.72%	406,394	4.72%	-15,873	-3.91%
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	396,632	4.80%	408,016	4.73%	-11,384	-2.79%
3.買入選擇權(Bought Options)	3,265	0.04%	2,225	0.03%	1,040	46.74%
4.賣出選擇權(Sold Options)	1,632	0.02%	2,225	0.03%	-593	-26.65%
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	5,084,914	61.54%	5,290,798	61.43%	-205,884	-3.89%
(一)店頭市場(OTC)	5,084,914	61.54%	5,290,798	61.43%	-205,884	-3.89%
1.遠期契約(Outright Forwards)	782,688	9.47%	842,780	9.78%	-60,092	-7.13%
2.換匯(Fx Swaps)	3,477,618	42.09%	3,718,838	43.18%	-241,220	-6.49%
3.換匯換利(Currency Swaps)	113,391	1.37%	59,384	0.69%	54,007	90.95%
4.買入選擇權(Bought Options)	353,724	4.28%	341,658	3.97%	12,066	3.53%
5.賣出選擇權(Sold Options)	357,493	4.33%	328,138	3.81%	29,355	8.95%
(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)	209,174	2.53%	226,701	2.63%	-17,527	-7.73%
(一)店頭市場(OTC)	177	0.00%	202	0.00%	-25	-12.38%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	208,997	2.53%	226,499	2.63%	-17,502	-7.73%
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	99,667	1.21%	191,791	2.23%	-92,124	-48.03%
(一)店頭市場(OTC)	61,599	0.75%	96,905	1.13%	-35,306	-36.43%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	38,068	0.46%	94,886	1.10%	-56,818	-59.88%
小 計(一至四)	8,257,965	99.94%	8,607,962	99.95%	-349,997	-4.07%
五、信用有關契約(Credit Contracts)	4,758	0.06%	4,628	0.05%	130	2.81%
1.信用違約交換(Credit Default Swap)	4,758	0.06%	4,628	0.05%	130	2.81%
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	8,262,723	100.00%	8,612,590	100.00%	-349,867	-4.06%

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。