

銀行衍生性金融商品交易量彙總表

98年12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)	439,107	643,260	1,082,367	12.88%
(一)店頭市場(OTC)	361,371	256,353	617,724	7.35%
1.遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-
2.換利(IRS)	329,661	233,673	563,334	6.70%
3.買入選擇權(Bought Options)	17,540	10,988	28,528	0.34%
4.賣出選擇權(Sold Options)	14,170	11,692	25,862	0.31%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	77,736	386,907	464,643	5.53%
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	38,718	186,829	225,547	2.68%
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	39,018	199,202	238,220	2.84%
3.買入選擇權(Bought Options)	-	876	876	0.01%
4.賣出選擇權(Sold Options)	-	-	-	-
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	3,357,823	3,586,343	6,944,166	82.61%
(一)店頭市場(OTC)	3,357,823	3,586,343	6,944,166	82.61%
1.遠期契約(Outright Forwards)	390,579	297,221	687,800	8.18%
2.換匯(Fx Swaps)	2,823,991	2,566,783	5,390,774	64.13%
3.換匯換利(Currency Swaps)	40,871	2,122	42,993	0.51%
4.買入選擇權(Bought Options)	49,048	360,315	409,363	4.87%
5.賣出選擇權(Sold Options)	53,334	359,902	413,236	4.92%
(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)	272,141	3,790	275,931	3.28%
(一)店頭市場(OTC)	441	147	588	0.01%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	271,700	3,643	275,343	3.27%
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	45,424	48,244	93,668	1.11%
(一)店頭市場(OTC)	-	47,896	47,896	0.57%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	45,424	348	45,772	0.54%
小 計(一至四)	4,114,495	4,281,637	8,396,132	99.88%
五、信用有關契約(Credit Contracts)	100	10,029	10,129	0.12%
1.信用違約交換(Credit Default Swap)	100	10,029	10,129	0.12%
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	4,114,595	4,291,666	8,406,261	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12月份

單位：新臺幣百萬元

商 品 種 類	98年12月		98年11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)	1,082,367	12.88%	1,349,071	15.29%	-266,704	-19.77%
(一)店頭市場(OTC)	617,724	7.35%	633,813	7.19%	-16,089	-2.54%
1. 遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-	-	-
2. 換利(IRS)	563,334	6.70%	589,046	6.68%	-25,712	-4.37%
3. 買入選擇權(Bought Options)	28,528	0.34%	30,733	0.35%	-2,205	-7.17%
4. 賣出選擇權(Sold Options)	25,862	0.31%	14,034	0.16%	11,828	84.28%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	464,643	5.53%	715,258	8.10%	-250,615	-35.04%
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	225,547	2.68%	367,302	4.16%	-141,755	-38.59%
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	238,220	2.84%	339,475	3.85%	-101,255	-29.83%
3. 買入選擇權(Bought Options)	876	0.01%	4,658	0.05%	-3,782	-81.19%
4. 賣出選擇權(Sold Options)	-	-	3,823	0.04%	-3,823	-100.00%
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	6,944,166	82.61%	7,110,271	80.59%	-166,105	-2.34%
(一)店頭市場(OTC)	6,944,166	82.61%	7,110,271	80.59%	-166,105	-2.34%
1. 遠期契約(Outright Forwards)	687,800	8.18%	780,192	8.84%	-92,392	-11.84%
2. 換匯(Fx Swaps)	5,390,774	64.13%	5,179,964	58.72%	210,810	4.07%
3. 換匯換利(Currency Swaps)	42,993	0.51%	73,411	0.83%	-30,418	-41.44%
4. 買入選擇權(Bought Options)	409,363	4.87%	544,452	6.17%	-135,089	-24.81%
5. 賣出選擇權(Sold Options)	413,236	4.92%	532,252	6.03%	-119,016	-22.36%
(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)	275,931	3.28%	280,521	3.18%	-4,590	-1.64%
(一)店頭市場(OTC)	588	0.01%	884	0.01%	-296	-33.48%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	275,343	3.27%	279,637	3.17%	-4,294	-1.54%
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	93,668	1.11%	70,325	0.80%	23,343	33.19%
(一)店頭市場(OTC)	47,896	0.57%	27,087	0.31%	20,809	76.82%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	45,772	0.54%	43,238	0.49%	2,534	5.86%
小 計(一至四)	8,396,132	99.88%	8,810,188	99.86%	-414,056	-4.70%
五、信用有關契約(Credit Contracts)	10,129	0.12%	12,166	0.14%	-2,037	-16.74%
1. 信用違約交換(Credit Default Swap)	10,129	0.12%	12,166	0.14%	-2,037	-16.74%
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	8,406,261	100.00%	8,822,354	100.00%	-416,093	-4.72%

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。