

銀行衍生性金融商品交易量彙總表

98年6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)	551,811	2,970,427	3,522,238	36.83%
(一)店頭市場(OTC)	549,041	2,016,021	2,565,062	26.83%
1.遠期利率協議(FRA)	-	33,476	33,476	0.35%
2.換利(IRS)	492,289	1,975,621	2,467,910	25.81%
3.買入選擇權(Bought Options)	30,983	6,027	37,010	0.39%
4.賣出選擇權(Sold Options)	25,769	897	26,666	0.28%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	2,770	954,406	957,176	10.00%
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	1,385	477,874	479,259	5.01%
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	1,385	473,293	474,678	4.96%
3.買入選擇權(Bought Options)	-	-	-	-
4.賣出選擇權(Sold Options)	-	3,239	3,239	0.03%
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	3,009,429	2,697,408	5,706,837	59.67%
(一)店頭市場(OTC)	3,009,429	2,697,408	5,706,837	59.67%
1.遠期契約(Outright Forwards)	470,541	287,048	757,589	7.92%
2.換匯(Fx Swaps)	2,285,737	1,720,082	4,005,819	41.89%
3.換匯換利(Currency Swaps)	75,717	2,042	77,759	0.81%
4.買入選擇權(Bought Options)	93,178	346,043	439,221	4.59%
5.賣出選擇權(Sold Options)	84,256	342,193	426,449	4.46%
(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)	230,287	3,102	233,389	2.44%
(一)店頭市場(OTC)	327	53	380	0.00%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	229,960	3,049	233,009	2.44%
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	37,993	59,027	97,020	1.02%
(一)店頭市場(OTC)	-	58,122	58,122	0.61%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	37,993	905	38,898	0.41%
小 計(一至四)	3,829,520	5,729,964	9,559,484	99.96%
五、信用有關契約(Credit Contracts)	75	3,748	3,823	0.04%
1.信用違約交換(Credit Default Swap)	75	3,748	3,823	0.04%
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	3,829,595	5,733,712	9,563,307	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6月份

單位：新臺幣百萬元

商 品 種 類	98年6月		98年5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)	3,522,238	36.83%	2,864,210	34.66%	658,028	22.97%
(一)店頭市場(OTC)	2,565,062	26.83%	2,072,160	25.08%	492,902	23.79%
1. 遠期利率協議(FRA)	33,476	0.35%	27,426	0.33%	6,050	22.06%
2. 換利(IRS)	2,467,910	25.81%	2,012,680	24.36%	455,230	22.62%
3. 買入選擇權(Bought Options)	37,010	0.39%	13,973	0.17%	23,037	164.87%
4. 賣出選擇權(Sold Options)	26,666	0.28%	18,081	0.22%	8,585	47.48%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	957,176	10.00%	792,050	9.58%	165,126	20.85%
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	479,259	5.01%	390,521	4.72%	88,738	22.72%
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	474,678	4.96%	396,632	4.80%	78,046	19.68%
3. 買入選擇權(Bought Options)	-	-	3,265	0.04%	-3,265	-100.00%
4. 賣出選擇權(Sold Options)	3,239	0.03%	1,632	0.02%	1,607	98.47%
二、匯率有關契約 (Foreign Exchange Transactions)	5,706,837	59.67%	5,084,914	61.54%	621,923	12.23%
(一)店頭市場(OTC)	5,706,837	59.67%	5,084,914	61.54%	621,923	12.23%
1. 遠期契約(Outright Forwards)	757,589	7.92%	782,688	9.47%	-25,099	-3.21%
2. 換匯(Fx Swaps)	4,005,819	41.89%	3,477,618	42.09%	528,201	15.19%
3. 換匯換利(Currency Swaps)	77,759	0.81%	113,391	1.37%	-35,632	-31.42%
4. 買入選擇權(Bought Options)	439,221	4.59%	353,724	4.28%	85,497	24.17%
5. 賣出選擇權(Sold Options)	426,449	4.46%	357,493	4.33%	68,956	19.29%
(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)	233,389	2.44%	209,174	2.53%	24,215	11.58%
(一)店頭市場(OTC)	380	0.00%	177	0.00%	203	114.69%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	233,009	2.44%	208,997	2.53%	24,012	11.49%
四、商品有關契約 (Commodity Contracts)	97,020	1.02%	99,667	1.21%	-2,647	-2.66%
(一)店頭市場(OTC)	58,122	0.61%	61,599	0.75%	-3,477	-5.64%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	38,898	0.41%	38,068	0.46%	830	2.18%
小 計(一至四)	9,559,484	99.96%	8,257,965	99.94%	1,301,519	15.76%
五、信用有關契約 (Credit Contracts)	3,823	0.04%	4,758	0.06%	-935	-19.65%
1. 信用違約交換(Credit Default Swap)	3,823	0.04%	4,758	0.06%	-935	-19.65%
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	9,563,307	100.00%	8,262,723	100.00%	1,300,584	15.74%

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。