

銀行衍生性金融商品交易量彙總表

98年11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)	515,351	833,720	1,349,071	15.29%
(一)店頭市場(OTC)	433,477	200,336	633,813	7.19%
1.遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-
2.換利(IRS)	406,273	182,773	589,046	6.68%
3.買入選擇權(Bought Options)	14,129	16,604	30,733	0.35%
4.賣出選擇權(Sold Options)	13,075	959	14,034	0.16%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	81,874	633,384	715,258	8.10%
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	40,937	326,365	367,302	4.16%
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	40,937	298,538	339,475	3.85%
3.買入選擇權(Bought Options)	-	4,658	4,658	0.05%
4.賣出選擇權(Sold Options)	-	3,823	3,823	0.04%
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	3,706,049	3,404,222	7,110,271	80.59%
(一)店頭市場(OTC)	3,706,049	3,404,222	7,110,271	80.59%
1.遠期契約(Outright Forwards)	432,170	348,022	780,192	8.84%
2.換匯(Fx Swaps)	3,092,571	2,087,393	5,179,964	58.72%
3.換匯換利(Currency Swaps)	72,141	1,270	73,411	0.83%
4.買入選擇權(Bought Options)	56,758	487,694	544,452	6.17%
5.賣出選擇權(Sold Options)	52,409	479,843	532,252	6.03%
(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)	276,926	3,595	280,521	3.18%
(一)店頭市場(OTC)	366	518	884	0.01%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	276,560	3,077	279,637	3.17%
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	41,156	29,169	70,325	0.80%
(一)店頭市場(OTC)	-	27,087	27,087	0.31%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	41,156	2,082	43,238	0.49%
小 計(一至四)	4,539,482	4,270,706	8,810,188	99.86%
五、信用有關契約(Credit Contracts)	166	12,000	12,166	0.14%
1.信用違約交換(Credit Default Swap)	166	12,000	12,166	0.14%
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	4,539,648	4,282,706	8,822,354	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11月份

單位：新臺幣百萬元

商 品 種 類	98年11月		98年10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)	1,349,071	15.29%	1,855,182	20.84%	-506,111	-27.28%
(一)店頭市場(OTC)	633,813	7.19%	996,620	11.20%	-362,807	-36.40%
1.遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-	-	-
2.換利(IRS)	589,046	6.68%	932,240	10.47%	-343,194	-36.81%
3.買入選擇權(Bought Options)	30,733	0.35%	35,866	0.41%	-5,133	-14.31%
4.賣出選擇權(Sold Options)	14,034	0.16%	28,514	0.32%	-14,480	-50.78%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	715,258	8.10%	858,562	9.64%	-143,304	-16.69%
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	367,302	4.16%	411,465	4.62%	-44,163	-10.73%
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	339,475	3.85%	434,648	4.88%	-95,173	-21.90%
3.買入選擇權(Bought Options)	4,658	0.05%	7,223	0.08%	-2,565	-35.51%
4.賣出選擇權(Sold Options)	3,823	0.04%	5,226	0.06%	-1,403	-26.85%
二、匯率有關契約 (Foreign Exchange Transactions)	7,110,271	80.59%	6,679,218	75.02%	431,053	6.45%
(一)店頭市場(OTC)	7,110,271	80.59%	6,679,218	75.02%	431,053	6.45%
1.遠期契約(Outright Forwards)	780,192	8.84%	842,003	9.46%	-61,811	-7.34%
2.換匯(Fx Swaps)	5,179,964	58.72%	4,643,935	52.16%	536,029	11.54%
3.換匯換利(Currency Swaps)	73,411	0.83%	56,907	0.64%	16,504	29.00%
4.買入選擇權(Bought Options)	544,452	6.17%	564,740	6.34%	-20,288	-3.59%
5.賣出選擇權(Sold Options)	532,252	6.03%	571,633	6.42%	-39,381	-6.89%
(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)	280,521	3.18%	252,638	2.84%	27,883	11.04%
(一)店頭市場(OTC)	884	0.01%	294	0.00%	590	200.68%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	279,637	3.17%	252,344	2.84%	27,293	10.82%
四、商品有關契約 (Commodity Contracts)	70,325	0.80%	92,480	1.04%	-22,155	-23.96%
(一)店頭市場(OTC)	27,087	0.31%	49,119	0.55%	-22,032	-44.85%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	43,238	0.49%	43,361	0.49%	-123	-0.28%
小 計(一至四)	8,810,188	99.86%	8,879,518	99.74%	-69,330	-0.78%
五、信用有關契約 (Credit Contracts)	12,166	0.14%	23,277	0.26%	-11,111	-47.73%
1.信用違約交換(Credit Default Swap)	12,166	0.14%	23,277	0.26%	-11,111	-47.73%
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	8,822,354	100.00%	8,902,795	100.00%	-80,441	-0.90%

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。