

銀行衍生性金融商品交易量彙總表

98年8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)	678,702	2,775,015	3,453,717	36.29%
(一)店頭市場(OTC)	596,180	2,175,821	2,772,001	29.13%
1.遠期利率協議(FRA)	-	5,268	5,268	0.06%
2.換利(IRS)	541,162	2,155,477	2,696,639	28.33%
3.買入選擇權(Bought Options)	32,108	14,223	46,331	0.49%
4.賣出選擇權(Sold Options)	22,910	853	23,763	0.25%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	82,522	599,194	681,716	7.16%
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	41,261	274,592	315,853	3.32%
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	41,261	295,686	336,947	3.54%
3.買入選擇權(Bought Options)	-	13,428	13,428	0.14%
4.賣出選擇權(Sold Options)	-	15,488	15,488	0.16%
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	2,615,485	3,134,163	5,749,648	60.41%
(一)店頭市場(OTC)	2,615,485	3,134,163	5,749,648	60.41%
1.遠期契約(Outright Forwards)	430,736	343,375	774,111	8.13%
2.換匯(Fx Swaps)	1,988,488	1,922,741	3,911,229	41.10%
3.換匯換利(Currency Swaps)	62,183	2,375	64,558	0.68%
4.買入選擇權(Bought Options)	66,453	435,518	501,971	5.27%
5.賣出選擇權(Sold Options)	67,625	430,154	497,779	5.23%
(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)	214,900	2,778	217,678	2.29%
(一)店頭市場(OTC)	196	282	478	0.01%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	214,704	2,496	217,200	2.28%
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	37,079	48,315	85,394	0.90%
(一)店頭市場(OTC)	-	47,581	47,581	0.50%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	37,079	734	37,813	0.40%
小 計(一至四)	3,546,166	5,960,271	9,506,437	99.89%
五、信用有關契約(Credit Contracts)	243	10,326	10,569	0.11%
1.信用違約交換(Credit Default Swap)	243	10,326	10,569	0.11%
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	3,546,409	5,970,597	9,517,006	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8月份

單位：新臺幣百萬元

商 品 種 類	98年8月		98年7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)	3,453,717	36.29%	3,255,113	34.83%	198,604	6.10%
(一)店頭市場(OTC)	2,772,001	29.13%	2,496,057	26.71%	275,944	11.06%
1.遠期利率協議(FRA)	5,268	0.06%	-	-	5,268	-
2.換利(IRS)	2,696,639	28.33%	2,413,055	25.82%	283,584	11.75%
3.買入選擇權(Bought Options)	46,331	0.49%	38,489	0.41%	7,842	20.37%
4.賣出選擇權(Sold Options)	23,763	0.25%	44,513	0.48%	-20,750	-46.62%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	681,716	7.16%	759,056	8.12%	-77,340	-10.19%
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	315,853	3.32%	361,055	3.86%	-45,202	-12.52%
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	336,947	3.54%	370,080	3.96%	-33,133	-8.95%
3.買入選擇權(Bought Options)	13,428	0.14%	16,389	0.18%	-2,961	-18.07%
4.賣出選擇權(Sold Options)	15,488	0.16%	11,532	0.12%	3,956	34.30%
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	5,749,648	60.41%	5,730,547	61.32%	19,101	0.33%
(一)店頭市場(OTC)	5,749,648	60.41%	5,730,547	61.32%	19,101	0.33%
1.遠期契約(Outright Forwards)	774,111	8.13%	779,186	8.34%	-5,075	-0.65%
2.換匯(Fx Swaps)	3,911,229	41.10%	3,971,943	42.50%	-60,714	-1.53%
3.換匯換利(Currency Swaps)	64,558	0.68%	71,365	0.76%	-6,807	-9.54%
4.買入選擇權(Bought Options)	501,971	5.27%	459,032	4.91%	42,939	9.35%
5.賣出選擇權(Sold Options)	497,779	5.23%	449,021	4.81%	48,758	10.86%
(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)	217,678	2.29%	237,549	2.54%	-19,871	-8.37%
(一)店頭市場(OTC)	478	0.01%	302	0.00%	176	58.28%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	217,200	2.28%	237,247	2.54%	-20,047	-8.45%
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	85,394	0.90%	108,127	1.16%	-22,733	-21.02%
(一)店頭市場(OTC)	47,581	0.50%	70,212	0.75%	-22,631	-32.23%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	37,813	0.40%	37,915	0.41%	-102	-0.27%
小 計(一至四)	9,506,437	99.89%	9,331,336	99.85%	175,101	1.88%
五、信用有關契約(Credit Contracts)	10,569	0.11%	13,719	0.15%	-3,150	-22.96%
1.信用違約交換(Credit Default Swap)	10,569	0.11%	13,719	0.15%	-3,150	-22.96%
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	9,517,006	100.00%	9,345,055	100.00%	171,951	1.84%

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。