

銀行衍生性金融商品交易量彙總表

98年2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)	532,719	2,591,659	3,124,378	37.23%
(一)店頭市場(OTC)	453,785	1,587,368	2,041,153	24.32%
1.遠期利率協議(FRA)	-	17,475	17,475	0.21%
2.換利(IRS)	399,776	1,552,723	1,952,499	23.26%
3.買入選擇權(Bought Options)	28,612	15,424	44,036	0.53%
4.賣出選擇權(Sold Options)	25,397	1,746	27,143	0.32%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	78,934	1,004,291	1,083,225	12.91%
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	39,367	486,348	525,715	6.26%
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	39,567	476,486	516,053	6.15%
3.買入選擇權(Bought Options)	-	23,410	23,410	0.28%
4.賣出選擇權(Sold Options)	-	18,047	18,047	0.22%
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	2,563,943	2,402,381	4,966,324	59.16%
(一)店頭市場(OTC)	2,563,943	2,402,381	4,966,324	59.16%
1.遠期契約(Outright Forwards)	482,202	276,966	759,168	9.04%
2.換匯(Fx Swaps)	1,943,372	1,526,308	3,469,680	41.34%
3.換匯換利(Currency Swaps)	73,717	2,177	75,894	0.90%
4.買入選擇權(Bought Options)	35,075	303,236	338,311	4.03%
5.賣出選擇權(Sold Options)	29,577	293,694	323,271	3.85%
(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)	179,431	3,887	183,318	2.18%
(一)店頭市場(OTC)	72	70	142	0.00%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	179,359	3,817	183,176	2.18%
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	92,249	23,465	115,714	1.38%
(一)店頭市場(OTC)	-	20,788	20,788	0.25%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	92,249	2,677	94,926	1.13%
小 計(一至四)	3,368,342	5,021,392	8,389,734	99.95%
五、信用有關契約(Credit Contracts)	100	3,769	3,869	0.05%
1.信用違約交換(Credit Default Swap)	100	3,769	3,869	0.05%
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	3,368,442	5,025,161	8,393,603	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2月份

單位：新臺幣百萬元

商 品 種 類	98年2月		98年1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)	3,124,378	37.23%	2,344,384	36.27%	779,994	33.27%
(一)店頭市場(OTC)	2,041,153	24.32%	1,611,255	24.93%	429,898	26.68%
1. 遠期利率協議(FRA)	17,475	0.21%	57,205	0.89%	-39,730	-69.45%
2. 換利(IRS)	1,952,499	23.26%	1,509,381	23.35%	443,118	29.36%
3. 買入選擇權(Bought Options)	44,036	0.53%	30,298	0.47%	13,738	45.34%
4. 賣出選擇權(Sold Options)	27,143	0.32%	14,371	0.22%	12,772	88.87%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	1,083,225	12.91%	733,129	11.34%	350,096	47.75%
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	525,715	6.26%	338,726	5.24%	186,989	55.20%
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	516,053	6.15%	325,284	5.03%	190,769	58.65%
3. 買入選擇權(Bought Options)	23,410	0.28%	68,161	1.06%	-44,751	-65.65%
4. 賣出選擇權(Sold Options)	18,047	0.22%	958	0.01%	17,089	1783.82%
二、匯率有關契約 (Foreign Exchange Transactions)	4,966,324	59.16%	3,871,472	59.89%	1,094,852	28.28%
(一)店頭市場(OTC)	4,966,324	59.16%	3,871,472	59.89%	1,094,852	28.28%
1. 遠期契約(Outright Forwards)	759,168	9.04%	734,702	11.37%	24,466	3.33%
2. 換匯(Fx Swaps)	3,469,680	41.34%	2,616,056	40.47%	853,624	32.63%
3. 換匯換利(Currency Swaps)	75,894	0.90%	57,099	0.88%	18,795	32.92%
4. 買入選擇權(Bought Options)	338,311	4.03%	229,709	3.55%	108,602	47.28%
5. 賣出選擇權(Sold Options)	323,271	3.85%	233,906	3.62%	89,365	38.21%
(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)	183,318	2.18%	142,200	2.20%	41,118	28.92%
(一)店頭市場(OTC)	142	0.00%	243	0.00%	-101	-41.56%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	183,176	2.18%	141,957	2.20%	41,219	29.04%
四、商品有關契約 (Commodity Contracts)	115,714	1.38%	99,741	1.54%	15,973	16.01%
(一)店頭市場(OTC)	20,788	0.25%	41,610	0.64%	-20,822	-50.04%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	94,926	1.13%	58,131	0.90%	36,795	63.30%
小 計(一至四)	8,389,734	99.95%	6,457,797	99.90%	1,931,937	29.92%
五、信用有關契約 (Credit Contracts)	3,869	0.05%	6,433	0.10%	-2,564	-39.86%
1. 信用違約交換(Credit Default Swap)	3,869	0.05%	6,433	0.10%	-2,564	-39.86%
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	8,393,603	100.00%	6,464,230	100.00%	1,929,373	29.85%

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。