

銀行衍生性金融商品交易量彙總表

99年7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)	455,718	1,181,392	1,637,110	16.42%
(一)店頭市場(OTC)	455,718	180,066	635,784	6.38%
1. 遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-
2. 換利(IRS)	415,233	173,995	589,228	5.91%
3. 買入選擇權(Bought Options)	19,315	-	19,315	0.20%
4. 賣出選擇權(Sold Options)	21,170	6,071	27,241	0.27%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	1,001,326	1,001,326	10.04%
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	-	502,110	502,110	5.03%
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	-	499,216	499,216	5.01%
3. 買入選擇權(Bought Options)	-	-	-	-
4. 賣出選擇權(Sold Options)	-	-	-	-
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	4,081,395	3,800,260	7,881,655	79.05%
(一)店頭市場(OTC)	4,081,395	3,800,260	7,881,655	79.05%
1. 遠期契約(Outright Forwards)	414,097	362,600	776,697	7.79%
2. 換匯(Fx Swaps)	3,513,032	2,554,891	6,067,923	60.86%
3. 換匯換利(Currency Swaps)	56,467	-	56,467	0.57%
4. 買入選擇權(Bought Options)	46,745	439,673	486,418	4.88%
5. 賣出選擇權(Sold Options)	51,054	443,096	494,150	4.95%
(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)	370,462	5,911	376,373	3.78%
(一)店頭市場(OTC)	248	135	383	0.01%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	370,214	5,776	375,990	3.77%
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	503	60,586	61,089	0.61%
(一)店頭市場(OTC)	-	59,226	59,226	0.59%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	503	1,360	1,863	0.02%
小 計(一至四)	4,908,078	5,048,149	9,956,227	99.86%
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	13,910	13,910	0.14%
1. 信用違約交換(Credit Default Swap)	-	13,910	13,910	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	4,908,078	5,062,059	9,970,137	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

99年7月份

單位：新臺幣百萬元

商 品 種 類	99年7月		99年6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)	1,637,110	16.42%	1,908,646	19.76%	-271,536	-14.23%
(一)店頭市場(OTC)	635,784	6.38%	891,335	9.23%	-255,551	-28.67%
1. 遠期利率協議(FRA)	-	-	16,131	0.17%	-16,131	-100.00%
2. 換利(IRS)	589,228	5.91%	785,314	8.13%	-196,086	-24.97%
3. 買入選擇權(Bought Options)	19,315	0.20%	49,895	0.52%	-30,580	-61.29%
4. 賣出選擇權(Sold Options)	27,241	0.27%	39,995	0.41%	-12,754	-31.89%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	1,001,326	10.04%	1,017,311	10.53%	-15,985	-1.57%
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	502,110	5.03%	540,709	5.60%	-38,599	-7.14%
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	499,216	5.01%	476,602	4.93%	22,614	4.74%
3. 買入選擇權(Bought Options)	-	-	-	-	-	-
4. 賣出選擇權(Sold Options)	-	-	-	-	-	-
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	7,881,655	79.05%	7,307,550	75.64%	574,105	7.86%
(一)店頭市場(OTC)	7,881,655	79.05%	7,307,550	75.64%	574,105	7.86%
1. 遠期契約(Outright Forwards)	776,697	7.79%	796,330	8.24%	-19,633	-2.47%
2. 換匯(Fx Swaps)	6,067,923	60.86%	5,561,391	57.57%	506,532	9.11%
3. 換匯換利(Currency Swaps)	56,467	0.57%	39,689	0.41%	16,778	42.27%
4. 買入選擇權(Bought Options)	486,418	4.88%	454,270	4.70%	32,148	7.08%
5. 賣出選擇權(Sold Options)	494,150	4.95%	455,870	4.72%	38,280	8.40%
(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)	376,373	3.78%	349,516	3.62%	26,857	7.68%
(一)店頭市場(OTC)	383	0.01%	777	0.01%	-394	-50.71%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	375,990	3.77%	348,739	3.61%	27,251	7.81%
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	61,089	0.61%	74,955	0.77%	-13,866	-18.50%
(一)店頭市場(OTC)	59,226	0.59%	63,006	0.65%	-3,780	-6.00%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	1,863	0.02%	11,949	0.12%	-10,086	-84.41%
小 計(一至四)	9,956,227	99.86%	9,640,667	99.79%	315,560	3.27%
五、信用有關契約(Credit Contracts)	13,910	0.14%	20,487	0.21%	-6,577	-32.10%
1. 信用違約交換(Credit Default Swap)	13,910	0.14%	20,487	0.21%	-6,577	-32.10%
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	9,970,137	100.00%	9,661,154	100.00%	308,983	3.20%

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。