

銀行衍生性金融商品交易量彙總表

99年12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)	270,971	1,257,480	1,528,451	15.52%
(一)店頭市場(OTC)	270,971	68,463	339,434	3.45%
1. 遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-
2. 換利(IRS)	237,448	67,974	305,422	3.10%
3. 買入選擇權(Bought Options)	12,201	-	12,201	0.13%
4. 賣出選擇權(Sold Options)	21,322	489	21,811	0.22%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	1,189,017	1,189,017	12.07%
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	-	570,991	570,991	5.80%
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	-	598,459	598,459	6.08%
3. 買入選擇權(Bought Options)	-	7,500	7,500	0.07%
4. 賣出選擇權(Sold Options)	-	12,067	12,067	0.12%
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	3,945,213	3,942,198	7,887,411	80.09%
(一)店頭市場(OTC)	3,945,213	3,942,198	7,887,411	80.09%
1. 遠期契約(Outright Forwards)	391,255	320,266	711,521	7.23%
2. 換匯(Fx Swaps)	3,485,824	2,701,545	6,187,369	62.83%
3. 換匯換利(Currency Swaps)	29,654	911	30,565	0.31%
4. 買入選擇權(Bought Options)	20,318	464,613	484,931	4.92%
5. 賣出選擇權(Sold Options)	18,162	454,863	473,025	4.80%
(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)	371,761	3,219	374,980	3.81%
(一)店頭市場(OTC)	320	251	571	0.01%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	371,441	2,968	374,409	3.80%
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	1,289	53,075	54,364	0.55%
(一)店頭市場(OTC)	-	48,520	48,520	0.49%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	1,289	4,555	5,844	0.06%
小 計(一至四)	4,589,234	5,255,972	9,845,206	99.97%
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	2,989	2,989	0.03%
1. 信用違約交換(Credit Default Swap)	-	2,989	2,989	0.03%
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	4,589,234	5,258,961	9,848,195	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12月份

單位：新臺幣百萬元

商 品 種 類	99年12月		99年11月		比較增減	
	台外幣合計	百分比	台外幣合計	百分比	差 額	百分比
一、利率有關契約(Interest Rate Contracts)	1,528,451	15.52%	1,867,297	19.21%	-338,846	-18.15%
(一)店頭市場(OTC)	339,434	3.45%	472,128	4.86%	-132,694	-28.11%
1. 遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-	-	0.00%
2. 換利(IRS)	305,422	3.10%	443,113	4.56%	-137,691	-31.07%
3. 買入選擇權(Bought Options)	12,201	0.13%	17,452	0.18%	-5,251	-30.09%
4. 賣出選擇權(Sold Options)	21,811	0.22%	11,563	0.12%	10,248	88.63%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	1,189,017	12.07%	1,395,169	14.35%	-206,152	-14.78%
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	570,991	5.80%	682,111	7.02%	-111,120	-16.29%
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	598,459	6.08%	713,058	7.33%	-114,599	-16.07%
3. 買入選擇權(Bought Options)	7,500	0.07%	-	-	7,500	-
4. 賣出選擇權(Sold Options)	12,067	0.12%	-	-	12,067	-
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	7,887,411	80.09%	7,405,057	76.18%	482,354	6.51%
(一)店頭市場(OTC)	7,887,411	80.09%	7,405,057	76.18%	482,354	6.51%
1. 遠期契約(Outright Forwards)	711,521	7.23%	691,060	7.11%	20,461	2.96%
2. 換匯(Fx Swaps)	6,187,369	62.83%	5,416,920	55.72%	770,449	14.22%
3. 換匯換利(Currency Swaps)	30,565	0.31%	85,824	0.88%	-55,259	-64.39%
4. 買入選擇權(Bought Options)	484,931	4.92%	610,977	6.29%	-126,046	-20.63%
5. 賣出選擇權(Sold Options)	473,025	4.80%	600,276	6.18%	-127,251	-21.20%
(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)	374,980	3.81%	388,255	3.99%	-13,275	-3.42%
(一)店頭市場(OTC)	571	0.01%	703	0.01%	-132	-18.78%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	374,409	3.80%	387,552	3.98%	-13,143	-3.39%
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	54,364	0.55%	46,614	0.48%	7,750	16.63%
(一)店頭市場(OTC)	48,520	0.49%	42,073	0.43%	6,447	15.32%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	5,844	0.06%	4,541	0.05%	1,303	28.69%
小 計(一至四)	9,845,206	99.97%	9,707,223	99.86%	137,983	1.42%
五、信用有關契約(Credit Contracts)	2,989	0.03%	13,753	0.14%	-10,764	-78.27%
1. 信用違約交換(Credit Default Swap)	2,989	0.03%	13,753	0.14%	-10,764	-78.27%
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	9,848,195	100.00%	9,720,976	100.00%	127,219	1.31%

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。