

銀行衍生性金融商品交易量彙總表

99年6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)	533,659	1,374,987	1,908,646	19.76%
(一)店頭市場(OTC)	533,633	357,702	891,335	9.23%
1. 遠期利率協議(FRA)	12,911	3,220	16,131	0.17%
2. 換利(IRS)	443,199	342,115	785,314	8.13%
3. 買入選擇權(Bought Options)	38,011	11,884	49,895	0.52%
4. 賣出選擇權(Sold Options)	39,512	483	39,995	0.41%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	26	1,017,285	1,017,311	10.53%
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	-	540,709	540,709	5.60%
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	26	476,576	476,602	4.93%
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)	3,547,995	3,759,555	7,307,550	75.64%
(一)店頭市場(OTC)	3,547,995	3,759,555	7,307,550	75.64%
1. 遠期契約(Outright Forwards)	424,322	372,008	796,330	8.24%
2. 換匯(Fx Swaps)	3,024,064	2,537,327	5,561,391	57.57%
3. 換匯換利(Currency Swaps)	38,721	968	39,689	0.41%
4. 買入選擇權(Bought Options)	30,702	423,568	454,270	4.70%
5. 賣出選擇權(Sold Options)	30,186	425,684	455,870	4.72%
(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)	343,989	5,527	349,516	3.62%
(一)店頭市場(OTC)	484	293	777	0.01%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	343,505	5,234	348,739	3.61%
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	768	74,187	74,955	0.77%
(一)店頭市場(OTC)	-	63,006	63,006	0.65%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	768	11,181	11,949	0.12%
小 計(一至四)	4,426,411	5,214,256	9,640,667	99.79%
五、信用有關契約(Credit Contracts)	100	20,387	20,487	0.21%
1. 信用違約交換(Credit Default Swap)	100	20,387	20,487	0.21%
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	4,426,511	5,234,643	9,661,154	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6月份

單位：新臺幣百萬元

商 品 種 類	99年6月		99年5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)	1,908,646	19.76%	2,483,416	22.31%	-574,770	-23.14%
(一)店頭市場(OTC)	891,335	9.23%	1,084,992	9.75%	-193,657	-17.85%
1. 遠期利率協議(FRA)	16,131	0.17%	8,023	0.07%	8,108	101.06%
2. 換利(IRS)	785,314	8.13%	944,031	8.48%	-158,717	-16.81%
3. 買入選擇權(Bought Options)	49,895	0.52%	90,157	0.81%	-40,262	-44.66%
4. 賣出選擇權(Sold Options)	39,995	0.41%	42,781	0.39%	-2,786	-6.51%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	1,017,311	10.53%	1,398,424	12.56%	-381,113	-27.25%
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	540,709	5.60%	670,635	6.02%	-129,926	-19.37%
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	476,602	4.93%	725,409	6.52%	-248,807	-34.30%
3. 買入選擇權(Bought Options)	-	-	1,983	0.02%	-1,983	-100.00%
4. 賣出選擇權(Sold Options)	-	-	397	0.00%	-397	-100.00%
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	7,307,550	75.64%	7,957,638	71.48%	-650,088	-8.17%
(一)店頭市場(OTC)	7,307,550	75.64%	7,957,638	71.48%	-650,088	-8.17%
1. 遠期契約(Outright Forwards)	796,330	8.24%	1,002,247	9.00%	-205,917	-20.55%
2. 換匯(Fx Swaps)	5,561,391	57.57%	5,646,455	50.72%	-85,064	-1.51%
3. 換匯換利(Currency Swaps)	39,689	0.41%	132,599	1.19%	-92,910	-70.07%
4. 買入選擇權(Bought Options)	454,270	4.70%	583,004	5.24%	-128,734	-22.08%
5. 賣出選擇權(Sold Options)	455,870	4.72%	593,333	5.33%	-137,463	-23.17%
(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)	349,516	3.62%	581,713	5.23%	-232,197	-39.92%
(一)店頭市場(OTC)	777	0.01%	1,931	0.02%	-1,154	-59.76%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	348,739	3.61%	579,782	5.21%	-231,043	-39.85%
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	74,955	0.77%	55,410	0.50%	19,545	35.27%
(一)店頭市場(OTC)	63,006	0.65%	45,749	0.41%	17,257	37.72%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	11,949	0.12%	9,661	0.09%	2,288	23.68%
小 計(一至四)	9,640,667	99.79%	11,078,177	99.52%	-1,437,510	-12.98%
五、信用有關契約(Credit Contracts)	20,487	0.21%	53,868	0.48%	-33,381	-61.97%
1. 信用違約交換(Credit Default Swap)	20,487	0.21%	53,868	0.48%	-33,381	-61.97%
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	9,661,154	100.00%	11,132,045	100.00%	-1,470,891	-13.21%

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。