

銀行衍生性金融商品交易量彙總表

99年8月

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)	508,471	1,880,496	2,388,967	21.84%
(一)店頭市場(OTC)	508,471	263,908	772,379	7.06%
1.遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-
2.換利(IRS)	444,021	253,737	697,758	6.38%
3.買入選擇權(Bought Options)	36,404	6	36,410	0.33%
4.賣出選擇權(Sold Options)	28,046	10,165	38,211	0.35%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	1,616,588	1,616,588	14.78%
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	-	814,572	814,572	7.44%
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	-	798,164	798,164	7.30%
3.買入選擇權(Bought Options)	-	1,926	1,926	0.02%
4.賣出選擇權(Sold Options)	-	1,926	1,926	0.02%
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	3,934,121	4,132,886	8,067,007	73.74%
(一)店頭市場(OTC)	3,934,121	4,132,886	8,067,007	73.74%
1.遠期契約(Outright Forwards)	449,640	351,999	801,639	7.33%
2.換匯(Fx Swaps)	3,394,331	2,622,179	6,016,510	55.00%
3.換匯換利(Currency Swaps)	27,284	-	27,284	0.25%
4.買入選擇權(Bought Options)	34,346	580,885	615,231	5.62%
5.賣出選擇權(Sold Options)	28,520	577,823	606,343	5.54%
(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)	349,535	7,867	357,402	3.27%
(一)店頭市場(OTC)	240	171	411	0.01%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	349,295	7,696	356,991	3.26%
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	546	104,180	104,726	0.96%
(一)店頭市場(OTC)	-	62,326	62,326	0.57%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	546	41,854	42,400	0.39%
小 計(一至四)	4,792,673	6,125,429	10,918,102	99.81%
五、信用有關契約(Credit Contracts)	10	20,742	20,752	0.19%
1.信用違約交換(Credit Default Swap)	10	20,742	20,752	0.19%
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	4,792,683	6,146,171	10,938,854	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8月

單位：新臺幣百萬元

商 品 種 類	99年8月		99年7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)	2,388,967	21.84%	1,637,110	16.42%	751,857	45.93%
(一)店頭市場(OTC)	772,379	7.06%	635,784	6.38%	136,595	21.48%
1. 遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-	-	-
2. 換利(IRS)	697,758	6.38%	589,228	5.91%	108,530	18.42%
3. 買入選擇權(Bought Options)	36,410	0.33%	19,315	0.20%	17,095	88.51%
4. 賣出選擇權(Sold Options)	38,211	0.35%	27,241	0.27%	10,970	40.27%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	1,616,588	14.78%	1,001,326	10.04%	615,262	61.44%
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	814,572	7.44%	502,110	5.03%	312,462	62.23%
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	798,164	7.30%	499,216	5.01%	298,948	59.88%
3. 買入選擇權(Bought Options)	1,926	0.02%	-	-	1,926	-
4. 賣出選擇權(Sold Options)	1,926	0.02%	-	-	1,926	-
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	8,067,007	73.74%	7,881,655	79.05%	185,352	2.35%
(一)店頭市場(OTC)	8,067,007	73.74%	7,881,655	79.05%	185,352	2.35%
1. 遠期契約(Outright Forwards)	801,639	7.33%	776,697	7.79%	24,942	3.21%
2. 換匯(Fx Swaps)	6,016,510	55.00%	6,067,923	60.86%	-51,413	-0.85%
3. 換匯換利(Currency Swaps)	27,284	0.25%	56,467	0.57%	-29,183	-51.68%
4. 買入選擇權(Bought Options)	615,231	5.62%	486,418	4.88%	128,813	26.48%
5. 賣出選擇權(Sold Options)	606,343	5.54%	494,150	4.95%	112,193	22.70%
(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)	357,402	3.27%	376,373	3.78%	-18,971	-5.04%
(一)店頭市場(OTC)	411	0.01%	383	0.01%	28	7.31%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	356,991	3.26%	375,990	3.77%	-18,999	-5.05%
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	104,726	0.96%	61,089	0.61%	43,637	71.43%
(一)店頭市場(OTC)	62,326	0.57%	59,226	0.59%	3,100	5.23%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	42,400	0.39%	1,863	0.02%	40,537	2,175.90%
小 計(一至四)	10,918,102	99.81%	9,956,227	99.86%	961,875	9.66%
五、信用有關契約(Credit Contracts)	20,752	0.19%	13,910	0.14%	6,842	49.19%
1. 信用違約交換(Credit Default Swap)	20,752	0.19%	13,910	0.14%	6,842	49.19%
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	10,938,854	100.00%	9,970,137	100.00%	968,717	9.72%

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。