

銀行衍生性金融商品交易量彙總表

99年4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)	562,797	1,668,664	2,231,461	22.18%
(一)店頭市場(OTC)	562,797	492,344	1,055,141	10.49%
1. 遠期利率協議(FRA)	1,157	471	1,628	0.02%
2. 換利(IRS)	500,599	488,733	989,332	9.83%
3. 買入選擇權(Bought Options)	33,422	-	33,422	0.33%
4. 賣出選擇權(Sold Options)	27,619	3,140	30,759	0.31%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	1,176,320	1,176,320	11.69%
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	-	580,280	580,280	5.76%
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	-	594,370	594,370	5.91%
3. 買入選擇權(Bought Options)	-	-	-	-
4. 賣出選擇權(Sold Options)	-	1,670	1,670	0.02%
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	3,673,401	3,563,455	7,236,856	71.95%
(一)店頭市場(OTC)	3,673,401	3,563,455	7,236,856	71.95%
1. 遠期契約(Outright Forwards)	492,123	452,160	944,283	9.39%
2. 換匯(Fx Swaps)	2,967,519	2,058,220	5,025,739	49.96%
3. 換匯換利(Currency Swaps)	49,021	-	49,021	0.49%
4. 買入選擇權(Bought Options)	79,930	528,956	608,886	6.05%
5. 賣出選擇權(Sold Options)	84,808	524,119	608,927	6.06%
(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)	489,837	1,852	491,689	4.89%
(一)店頭市場(OTC)	659	313	972	0.01%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	489,178	1,539	490,717	4.88%
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	701	60,952	61,653	0.61%
(一)店頭市場(OTC)	-	55,582	55,582	0.55%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	701	5,370	6,071	0.06%
小 計(一至四)	4,726,736	5,294,923	10,021,659	99.63%
五、信用有關契約(Credit Contracts)	100	37,229	37,329	0.37%
1. 信用違約交換(Credit Default Swap)	100	37,229	37,329	0.37%
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	4,726,836	5,332,152	10,058,988	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4月份

單位：新臺幣百萬元

商 品 種 類	99年4月		99年3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)	2,231,461	22.18%	2,317,093	22.05%	-85,632	-3.70%
(一)店頭市場(OTC)	1,055,141	10.49%	1,347,026	12.82%	-291,885	-21.67%
1. 遠期利率協議(FRA)	1,628	0.02%	7,954	0.08%	-6,326	-79.53%
2. 換利(IRS)	989,332	9.83%	1,217,846	11.59%	-228,514	-18.76%
3. 買入選擇權(Bought Options)	33,422	0.33%	63,231	0.60%	-29,809	-47.14%
4. 賣出選擇權(Sold Options)	30,759	0.31%	57,995	0.55%	-27,236	-46.96%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	1,176,320	11.69%	970,067	9.23%	206,253	21.26%
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	580,280	5.76%	480,012	4.57%	100,268	20.89%
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	594,370	5.91%	490,055	4.66%	104,315	21.29%
3. 買入選擇權(Bought Options)	-	-	-	-	-	-
4. 賣出選擇權(Sold Options)	1,670	0.02%	-	-	1,670	-
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	7,236,856	71.95%	7,729,764	73.55%	-492,908	-6.38%
(一)店頭市場(OTC)	7,236,856	71.95%	7,729,764	73.55%	-492,908	-6.38%
1. 遠期契約(Outright Forwards)	944,283	9.39%	810,421	7.71%	133,862	16.52%
2. 換匯(Fx Swaps)	5,025,739	49.96%	5,673,319	53.98%	-647,580	-11.41%
3. 換匯換利(Currency Swaps)	49,021	0.49%	88,048	0.84%	-39,027	-44.32%
4. 買入選擇權(Bought Options)	608,886	6.05%	575,525	5.48%	33,361	5.80%
5. 賣出選擇權(Sold Options)	608,927	6.06%	582,451	5.54%	26,476	4.55%
(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)	491,689	4.89%	367,169	3.49%	124,520	33.91%
(一)店頭市場(OTC)	972	0.01%	189	0.00%	783	414.29%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	490,717	4.88%	366,980	3.49%	123,737	33.72%
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	61,653	0.61%	76,270	0.73%	-14,617	-19.16%
(一)店頭市場(OTC)	55,582	0.55%	71,538	0.68%	-15,956	-22.30%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	6,071	0.06%	4,732	0.05%	1,339	28.30%
小 計(一至四)	10,021,659	99.63%	10,490,296	99.82%	-468,637	-4.47%
五、信用有關契約(Credit Contracts)	37,329	0.37%	18,931	0.18%	18,398	97.18%
1. 信用違約交換(Credit Default Swap)	37,329	0.37%	18,931	0.18%	18,398	97.18%
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	10,058,988	100.00%	10,509,227	100.00%	-450,239	-4.28%

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。