

銀行衍生性金融商品交易量彙總表

99年2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)	370,322	1,511,215	1,881,537	23.24%
(一)店頭市場(OTC)	370,322	727,608	1,097,930	13.56%
1. 遠期利率協議(FRA)	4,200	1,106	5,306	0.06%
2. 換利(IRS)	270,998	691,288	962,286	11.89%
3. 買入選擇權(Bought Options)	50,072	20,963	71,035	0.88%
4. 賣出選擇權(Sold Options)	45,052	14,251	59,303	0.73%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	783,607	783,607	9.68%
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	-	386,606	386,606	4.78%
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	-	397,001	397,001	4.90%
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)	2,839,033	3,028,846	5,867,879	72.48%
(一)店頭市場(OTC)	2,839,033	3,028,846	5,867,879	72.48%
1. 遠期契約(Outright Forwards)	294,757	283,669	578,426	7.15%
2. 換匯(Fx Swaps)	2,264,290	2,000,534	4,264,824	52.68%
3. 換匯換利(Currency Swaps)	50,203	128	50,331	0.62%
4. 買入選擇權(Bought Options)	108,140	367,840	475,980	5.88%
5. 賣出選擇權(Sold Options)	121,643	376,675	498,318	6.15%
(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)	225,645	4,089	229,734	2.84%
(一)店頭市場(OTC)	163	-	163	0.00%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	225,482	4,089	229,571	2.84%
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	607	58,827	59,434	0.74%
(一)店頭市場(OTC)	-	57,946	57,946	0.72%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	607	881	1,488	0.02%
小 計(一至四)	3,435,607	4,602,977	8,038,584	99.30%
五、信用有關契約(Credit Contracts)	10	56,721	56,731	0.70%
1. 信用違約交換(Credit Default Swap)	10	56,721	56,731	0.70%
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	3,435,617	4,659,698	8,095,315	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2月份

單位：新臺幣百萬元

商 品 種 類	99年2月		99年1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)	1,881,537	23.24%	2,377,985	24.19%	-496,448	-20.88%
(一)店頭市場(OTC)	1,097,930	13.56%	1,602,368	16.30%	-504,438	-31.48%
1. 遠期利率協議(FRA)	5,306	0.06%	10,350	0.11%	-5,044	-48.73%
2. 換利(IRS)	962,286	11.89%	1,493,067	15.19%	-530,781	-35.55%
3. 買入選擇權(Bought Options)	71,035	0.88%	55,267	0.56%	15,768	28.53%
4. 賣出選擇權(Sold Options)	59,303	0.73%	43,684	0.44%	15,619	35.75%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	783,607	9.68%	775,617	7.89%	7,990	1.03%
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	386,606	4.78%	384,288	3.91%	2,318	0.60%
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	397,001	4.90%	391,329	3.98%	5,672	1.45%
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)	5,867,879	72.48%	7,055,208	71.78%	-1,187,329	-16.83%
(一)店頭市場(OTC)	5,867,879	72.48%	7,055,208	71.78%	-1,187,329	-16.83%
1. 遠期契約(Outright Forwards)	578,426	7.15%	861,068	8.76%	-282,642	-32.82%
2. 換匯(Fx Swaps)	4,264,824	52.68%	4,981,942	50.69%	-717,118	-14.39%
3. 換匯換利(Currency Swaps)	50,331	0.62%	56,991	0.58%	-6,660	-11.69%
4. 買入選擇權(Bought Options)	475,980	5.88%	567,520	5.77%	-91,540	-16.13%
5. 賣出選擇權(Sold Options)	498,318	6.15%	587,687	5.98%	-89,369	-15.21%
(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)	229,734	2.84%	294,553	3.00%	-64,819	-22.01%
(一)店頭市場(OTC)	163	0.00%	1,114	0.01%	-951	-85.37%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	229,571	2.84%	293,439	2.99%	-63,868	-21.77%
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	59,434	0.74%	60,122	0.61%	-688	-1.14%
(一)店頭市場(OTC)	57,946	0.72%	57,940	0.59%	6	0.01%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	1,488	0.02%	2,182	0.02%	-694	-31.81%
小 計(一至四)	8,038,584	99.30%	9,787,868	99.58%	-1,749,284	-17.87%
五、信用有關契約(Credit Contracts)	56,731	0.70%	40,869	0.42%	15,862	38.81%
1. 信用違約交換(Credit Default Swap)	56,731	0.70%	40,869	0.42%	15,862	38.81%
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	8,095,315	100.00%	9,828,737	100.00%	-1,733,422	-17.64%

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。