

銀行衍生性金融商品交易量彙總表

99年3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)	830,611	1,486,482	2,317,093	22.05%
(一)店頭市場(OTC)	830,611	516,415	1,347,026	12.82%
1. 遠期利率協議(FRA)	7,000	954	7,954	0.08%
2. 換利(IRS)	710,409	507,437	1,217,846	11.59%
3. 買入選擇權(Bought Options)	59,894	3,337	63,231	0.60%
4. 賣出選擇權(Sold Options)	53,308	4,687	57,995	0.55%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	970,067	970,067	9.23%
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	-	480,012	480,012	4.57%
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	-	490,055	490,055	4.66%
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)	3,791,199	3,938,565	7,729,764	73.55%
(一)店頭市場(OTC)	3,791,199	3,938,565	7,729,764	73.55%
1. 遠期契約(Outright Forwards)	415,092	395,329	810,421	7.71%
2. 換匯(Fx Swaps)	3,085,448	2,587,871	5,673,319	53.98%
3. 換匯換利(Currency Swaps)	86,934	1,114	88,048	0.84%
4. 買入選擇權(Bought Options)	98,681	476,844	575,525	5.48%
5. 賣出選擇權(Sold Options)	105,044	477,407	582,451	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)	363,538	3,631	367,169	3.49%
(一)店頭市場(OTC)	119	70	189	0.00%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	363,419	3,561	366,980	3.49%
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	438	75,832	76,270	0.73%
(一)店頭市場(OTC)	-	71,538	71,538	0.68%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	438	4,294	4,732	0.05%
小 計(一至四)	4,985,786	5,504,510	10,490,296	99.82%
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	18,931	18,931	0.18%
1. 信用違約交換(Credit Default Swap)	-	18,931	18,931	0.18%
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	4,985,786	5,523,441	10,509,227	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3月份

單位：新臺幣百萬元

商 品 種 類	99年3月		99年2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)	2,317,093	22.05%	1,881,537	23.24%	435,556	23.15%
(一)店頭市場(OTC)	1,347,026	12.82%	1,097,930	13.56%	249,096	22.69%
1. 遠期利率協議(FRA)	7,954	0.08%	5,306	0.06%	2,648	49.91%
2. 換利(IRS)	1,217,846	11.59%	962,286	11.89%	255,560	26.56%
3. 買入選擇權(Bought Options)	63,231	0.60%	71,035	0.88%	-7,804	-10.99%
4. 賣出選擇權(Sold Options)	57,995	0.55%	59,303	0.73%	-1,308	-2.21%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	970,067	9.23%	783,607	9.68%	186,460	23.80%
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	480,012	4.57%	386,606	4.78%	93,406	24.16%
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	490,055	4.66%	397,001	4.90%	93,054	23.44%
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)	7,729,764	73.55%	5,867,879	72.48%	1,861,885	31.73%
(一)店頭市場(OTC)	7,729,764	73.55%	5,867,879	72.48%	1,861,885	31.73%
1. 遠期契約(Outright Forwards)	810,421	7.71%	578,426	7.15%	231,995	40.11%
2. 換匯(Fx Swaps)	5,673,319	53.98%	4,264,824	52.68%	1,408,495	33.03%
3. 換匯換利(Currency Swaps)	88,048	0.84%	50,331	0.62%	37,717	74.94%
4. 買入選擇權(Bought Options)	575,525	5.48%	475,980	5.88%	99,545	20.91%
5. 賣出選擇權(Sold Options)	582,451	5.54%	498,318	6.15%	84,133	16.88%
(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)	367,169	3.49%	229,734	2.84%	137,435	59.82%
(一)店頭市場(OTC)	189	0.00%	163	0.00%	26	15.95%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	366,980	3.49%	229,571	2.84%	137,409	59.85%
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	76,270	0.73%	59,434	0.74%	16,836	28.33%
(一)店頭市場(OTC)	71,538	0.68%	57,946	0.72%	13,592	23.46%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	4,732	0.05%	1,488	0.02%	3,244	218.01%
小 計(一至四)	10,490,296	99.82%	8,038,584	99.30%	2,451,712	30.50%
五、信用有關契約(Credit Contracts)	18,931	0.18%	56,731	0.70%	-37,800	-66.63%
1. 信用違約交換(Credit Default Swap)	18,931	0.18%	56,731	0.70%	-37,800	-66.63%
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	10,509,227	100.00%	8,095,315	100.00%	2,413,912	29.82%

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。