

銀行衍生性金融商品交易量彙總表

99年11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)	334, 391	1, 532, 906	1, 867, 297	19. 21%
(一)店頭市場(OTC)	334, 391	137, 737	472, 128	4. 86%
1. 遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-
2. 換利(IRS)	307, 450	135, 663	443, 113	4. 56%
3. 買入選擇權(Bought Options)	17, 452	-	17, 452	0. 18%
4. 賣出選擇權(Sold Options)	9, 489	2, 074	11, 563	0. 12%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	1, 395, 169	1, 395, 169	14. 35%
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	-	682, 111	682, 111	7. 02%
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	-	713, 058	713, 058	7. 33%
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, 593, 342	3, 811, 715	7, 405, 057	76. 18%
(一)店頭市場(OTC)	3, 593, 342	3, 811, 715	7, 405, 057	76. 18%
1. 遠期契約(Outright Forwards)	369, 021	322, 039	691, 060	7. 11%
2. 換匯(Fx Swaps)	3, 140, 295	2, 276, 625	5, 416, 920	55. 72%
3. 換匯換利(Currency Swaps)	34, 503	51, 321	85, 824	0. 88%
4. 買入選擇權(Bought Options)	26, 067	584, 910	610, 977	6. 29%
5. 賣出選擇權(Sold Options)	23, 456	576, 820	600, 276	6. 18%
(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)	383, 559	4, 696	388, 255	3. 99%
(一)店頭市場(OTC)	350	353	703	0. 01%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	383, 209	4, 343	387, 552	3. 98%
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	1, 072	45, 542	46, 614	0. 48%
(一)店頭市場(OTC)	-	42, 073	42, 073	0. 43%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	1, 072	3, 469	4, 541	0. 05%
小 計(一至四)	4, 312, 364	5, 394, 859	9, 707, 223	99. 86%
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	13, 753	13, 753	0. 14%
1. 信用違約交換(Credit Default Swap)	-	13, 753	13, 753	0. 14%
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, 312, 364	5, 408, 612	9, 720, 976	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11月

單位：新臺幣百萬元

商 品 種 類	99年11月		99年10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)	1,867,297	19.21%	2,216,296	21.71%	-348,999	-15.75%
(一)店頭市場(OTC)	472,128	4.86%	546,017	5.35%	-73,889	-13.53%
1. 遠期利率協議(FRA)	-	-	12,313	0.12%	-12,313	-100.00%
2. 換利(IRS)	443,113	4.56%	465,730	4.56%	-22,617	-4.86%
3. 買入選擇權(Bought Options)	17,452	0.18%	24,573	0.24%	-7,121	-28.98%
4. 賣出選擇權(Sold Options)	11,563	0.12%	43,401	0.43%	-31,838	-73.36%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	1,395,169	14.35%	1,670,279	16.36%	-275,110	-16.47%
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	682,111	7.02%	834,812	8.18%	-152,701	-18.29%
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	713,058	7.33%	835,467	8.18%	-122,409	-14.65%
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)	7,405,057	76.18%	7,528,294	73.73%	-123,237	-1.64%
(一)店頭市場(OTC)	7,405,057	76.18%	7,528,294	73.73%	-123,237	-1.64%
1. 遠期契約(Outright Forwards)	691,060	7.11%	812,397	7.96%	-121,337	-14.94%
2. 換匯(Fx Swaps)	5,416,920	55.72%	5,473,820	53.61%	-56,900	-1.04%
3. 換匯換利(Currency Swaps)	85,824	0.88%	96,079	0.94%	-10,255	-10.67%
4. 買入選擇權(Bought Options)	610,977	6.29%	578,670	5.67%	32,307	5.58%
5. 賣出選擇權(Sold Options)	600,276	6.18%	567,328	5.55%	32,948	5.81%
(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)	388,255	3.99%	404,315	3.96%	-16,060	-3.97%
(一)店頭市場(OTC)	703	0.01%	361	-	342	94.74%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	387,552	3.98%	403,954	3.96%	-16,402	-4.06%
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	46,614	0.48%	42,170	0.41%	4,444	10.54%
(一)店頭市場(OTC)	42,073	0.43%	37,420	0.36%	4,653	12.43%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	4,541	0.05%	4,750	0.05%	-209	-4.40%
小 計(一至四)	9,707,223	99.86%	10,191,075	99.81%	-483,852	-4.75%
五、信用有關契約(Credit Contracts)	13,753	0.14%	19,514	0.19%	-5,761	-29.52%
1. 信用違約交換(Credit Default Swap)	13,753	0.14%	19,514	0.19%	-5,761	-29.52%
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	9,720,976	100.00%	10,210,589	100.00%	-489,613	-4.80%

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。