

銀行衍生性金融商品交易量彙總表

99年10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)	416,337	1,799,959	2,216,296	21.71%
(一)店頭市場(OTC)	416,337	129,680	546,017	5.35%
1. 遠期利率協議(FRA)	-	12,313	12,313	0.12%
2. 換利(IRS)	366,925	98,805	465,730	4.56%
3. 買入選擇權(Bought Options)	24,169	404	24,573	0.24%
4. 賣出選擇權(Sold Options)	25,243	18,158	43,401	0.43%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	1,670,279	1,670,279	16.36%
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	-	834,812	834,812	8.18%
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	-	835,467	835,467	8.18%
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)	3,505,678	4,022,616	7,528,294	73.73%
(一)店頭市場(OTC)	3,505,678	4,022,616	7,528,294	73.73%
1. 遠期契約(Outright Forwards)	420,402	391,995	812,397	7.96%
2. 換匯(Fx Swaps)	2,989,938	2,483,882	5,473,820	53.61%
3. 換匯換利(Currency Swaps)	33,019	63,060	96,079	0.94%
4. 買入選擇權(Bought Options)	32,721	545,949	578,670	5.67%
5. 賣出選擇權(Sold Options)	29,598	537,730	567,328	5.55%
(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)	396,903	7,412	404,315	3.96%
(一)店頭市場(OTC)	205	156	361	-
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	396,698	7,256	403,954	3.96%
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	1,351	40,819	42,170	0.41%
(一)店頭市場(OTC)	-	37,420	37,420	0.36%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	1,351	3,399	4,750	0.05%
小 計(一至四)	4,320,269	5,870,806	10,191,075	99.81%
五、信用有關契約(Credit Contracts)	100	19,414	19,514	0.19%
1. 信用違約交換(Credit Default Swap)	100	19,414	19,514	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	4,320,369	5,890,220	10,210,589	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10月

單位：新臺幣百萬元

商 品 種 類	99年10月		99年9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)	2,216,296	21.71%	2,479,522	22.66%	-263,226	-10.62%
(一)店頭市場(OTC)	546,017	5.35%	585,225	5.35%	-39,208	-6.70%
1.遠期利率協議(FRA)	12,313	0.12%	400	-	11,913	2,978.25%
2.換利(IRS)	465,730	4.56%	534,684	4.89%	-68,954	-12.90%
3.買入選擇權(Bought Options)	24,573	0.24%	25,653	0.24%	-1,080	-4.21%
4.賣出選擇權(Sold Options)	43,401	0.43%	24,488	0.22%	18,913	77.23%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	1,670,279	16.36%	1,894,297	17.31%	-224,018	-11.83%
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	834,812	8.18%	934,579	8.54%	-99,767	-10.68%
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	835,467	8.18%	959,718	8.77%	-124,251	-12.95%
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)	7,528,294	73.73%	8,043,862	73.52%	-515,568	-6.41%
(一)店頭市場(OTC)	7,528,294	73.73%	8,043,862	73.52%	-515,568	-6.41%
1.遠期契約(Outright Forwards)	812,397	7.96%	828,639	7.57%	-16,242	-1.96%
2.換匯(Fx Swaps)	5,473,820	53.61%	5,914,880	54.06%	-441,060	-7.46%
3.換匯換利(Currency Swaps)	96,079	0.94%	37,518	0.34%	58,561	156.09%
4.買入選擇權(Bought Options)	578,670	5.67%	635,041	5.81%	-56,371	-8.88%
5.賣出選擇權(Sold Options)	567,328	5.55%	627,784	5.74%	-60,456	-9.63%
(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)	404,315	3.96%	345,945	3.16%	58,370	16.87%
(一)店頭市場(OTC)	361	-	215	-	146	67.91%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	403,954	3.96%	345,730	3.16%	58,224	16.84%
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	42,170	0.41%	48,043	0.44%	-5,873	-12.22%
(一)店頭市場(OTC)	37,420	0.36%	34,054	0.31%	3,366	9.88%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	4,750	0.05%	13,989	0.13%	-9,239	-66.04%
小 計(一至四)	10,191,075	99.81%	10,917,372	99.78%	-726,297	-6.65%
五、信用有關契約(Credit Contracts)	19,514	0.19%	23,636	0.22%	-4,122	-17.44%
1.信用違約交換(Credit Default Swap)	19,514	0.19%	23,636	0.22%	-4,122	-17.44%
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	10,210,589	100.00%	10,941,008	100.00%	-730,419	-6.68%

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。