

銀行衍生性金融商品交易量彙總表

99年9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)	436,924	2,042,598	2,479,522	22.66%
(一)店頭市場(OTC)	436,924	148,301	585,225	5.35%
1.遠期利率協議(FRA)	-	400	400	-
2.換利(IRS)	387,859	146,825	534,684	4.89%
3.買入選擇權(Bought Options)	25,582	71	25,653	0.24%
4.賣出選擇權(Sold Options)	23,483	1,005	24,488	0.22%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	1,894,297	1,894,297	17.31%
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	-	934,579	934,579	8.54%
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	-	959,718	959,718	8.77%
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)	3,748,196	4,295,666	8,043,862	73.52%
(一)店頭市場(OTC)	3,748,196	4,295,666	8,043,862	73.52%
1.遠期契約(Outright Forwards)	365,040	463,599	828,639	7.57%
2.換匯(Fx Swaps)	3,278,920	2,635,960	5,914,880	54.06%
3.換匯換利(Currency Swaps)	35,952	1,566	37,518	0.34%
4.買入選擇權(Bought Options)	34,364	600,677	635,041	5.81%
5.賣出選擇權(Sold Options)	33,920	593,864	627,784	5.74%
(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)	343,404	2,541	345,945	3.16%
(一)店頭市場(OTC)	139	76	215	-
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	343,265	2,465	345,730	3.16%
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	714	47,329	48,043	0.44%
(一)店頭市場(OTC)	-	34,054	34,054	0.31%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	714	13,275	13,989	0.13%
小 計(一至四)	4,529,238	6,388,134	10,917,372	99.78%
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	23,636	23,636	0.22%
1.信用違約交換(Credit Default Swap)	-	23,636	23,636	0.22%
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	4,529,238	6,411,770	10,941,008	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9月

單位：新臺幣百萬元

商 品 種 類	99年9月		99年8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)	2,479,522	22.66%	2,388,967	21.84%	90,555	3.79%
(一)店頭市場(OTC)	585,225	5.35%	772,379	7.06%	-187,154	-24.23%
1.遠期利率協議(FRA)	400	-	-	-	400	-
2.換利(IRS)	534,684	4.89%	697,758	6.38%	-163,074	-23.37%
3.買入選擇權(Bought Options)	25,653	0.24%	36,410	0.33%	-10,757	-29.54%
4.賣出選擇權(Sold Options)	24,488	0.22%	38,211	0.35%	-13,723	-35.91%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	1,894,297	17.31%	1,616,588	14.78%	277,709	17.18%
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	934,579	8.54%	814,572	7.44%	120,007	14.73%
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	959,718	8.77%	798,164	7.30%	161,554	20.24%
3.買入選擇權(Bought Options)	-	-	1,926	0.02%	-1,926	-100.00%
4.賣出選擇權(Sold Options)	-	-	1,926	0.02%	-1,926	-100.00%
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	8,043,862	73.52%	8,067,007	73.74%	-23,145	-0.29%
(一)店頭市場(OTC)	8,043,862	73.52%	8,067,007	73.74%	-23,145	-0.29%
1.遠期契約(Outright Forwards)	828,639	7.57%	801,639	7.33%	27,000	3.37%
2.換匯(Fx Swaps)	5,914,880	54.06%	6,016,510	55.00%	-101,630	-1.69%
3.換匯換利(Currency Swaps)	37,518	0.34%	27,284	0.25%	10,234	37.51%
4.買入選擇權(Bought Options)	635,041	5.81%	615,231	5.62%	19,810	3.22%
5.賣出選擇權(Sold Options)	627,784	5.74%	606,343	5.54%	21,441	3.54%
(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)	345,945	3.16%	357,402	3.27%	-11,457	-3.21%
(一)店頭市場(OTC)	215	-	411	0.01%	-196	-47.69%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	345,730	3.16%	356,991	3.26%	-11,261	-3.15%
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	48,043	0.44%	104,726	0.96%	-56,683	-54.13%
(一)店頭市場(OTC)	34,054	0.31%	62,326	0.57%	-28,272	-45.36%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	13,989	0.13%	42,400	0.39%	-28,411	-67.01%
小 計(一至四)	10,917,372	99.78%	10,918,102	99.81%	-730	-0.01%
五、信用有關契約(Credit Contracts)	23,636	0.22%	20,752	0.19%	2,884	13.90%
1.信用違約交換(Credit Default Swap)	23,636	0.22%	20,752	0.19%	2,884	13.90%
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	10,941,008	100.00%	10,938,854	100.00%	2,154	0.02%

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。