

銀行衍生性金融商品交易量彙總表

99年5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)	642,906	1,840,510	2,483,416	22.31%
(一)店頭市場(OTC)	642,880	442,112	1,084,992	9.75%
1. 遠期利率協議(FRA)	-	8,023	8,023	0.07%
2. 換利(IRS)	566,974	377,057	944,031	8.48%
3. 買入選擇權(Bought Options)	41,676	48,481	90,157	0.81%
4. 賣出選擇權(Sold Options)	34,230	8,551	42,781	0.39%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	26	1,398,398	1,398,424	12.56%
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	26	670,609	670,635	6.02%
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	-	725,409	725,409	6.52%
3. 買入選擇權(Bought Options)	-	1,983	1,983	0.02%
4. 賣出選擇權(Sold Options)	-	397	397	0.00%
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	4,194,953	3,762,685	7,957,638	71.48%
(一)店頭市場(OTC)	4,194,953	3,762,685	7,957,638	71.48%
1. 遠期契約(Outright Forwards)	545,987	456,260	1,002,247	9.00%
2. 換匯(Fx Swaps)	3,373,714	2,272,741	5,646,455	50.72%
3. 換匯換利(Currency Swaps)	132,599	-	132,599	1.19%
4. 買入選擇權(Bought Options)	67,997	515,007	583,004	5.24%
5. 賣出選擇權(Sold Options)	74,656	518,677	593,333	5.33%
(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)	572,071	9,642	581,713	5.23%
(一)店頭市場(OTC)	337	1,594	1,931	0.02%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	571,734	8,048	579,782	5.21%
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	878	54,532	55,410	0.50%
(一)店頭市場(OTC)	-	45,749	45,749	0.41%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	878	8,783	9,661	0.09%
小 計(一至四)	5,410,808	5,667,369	11,078,177	99.52%
五、信用有關契約(Credit Contracts)	30	53,838	53,868	0.48%
1. 信用違約交換(Credit Default Swap)	30	53,838	53,868	0.48%
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	5,410,838	5,721,207	11,132,045	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5月份

單位：新臺幣百萬元

商 品 種 類	99年5月		99年4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)	2,483,416	22.31%	2,231,461	22.18%	251,955	11.29%
(一)店頭市場(OTC)	1,084,992	9.75%	1,055,141	10.49%	29,851	2.83%
1. 遠期利率協議(FRA)	8,023	0.07%	1,628	0.02%	6,395	392.81%
2. 換利(IRS)	944,031	8.48%	989,332	9.83%	-45,301	-4.58%
3. 買入選擇權(Bought Options)	90,157	0.81%	33,422	0.33%	56,735	169.75%
4. 賣出選擇權(Sold Options)	42,781	0.39%	30,759	0.31%	12,022	39.08%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	1,398,424	12.56%	1,176,320	11.69%	222,104	18.88%
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	670,635	6.02%	580,280	5.76%	90,355	15.57%
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	725,409	6.52%	594,370	5.91%	131,039	22.05%
3. 買入選擇權(Bought Options)	1,983	0.02%	-	-	1,983	-
4. 賣出選擇權(Sold Options)	397	0.00%	1,670	0.02%	-1,273	(76.23%)
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	7,957,638	71.48%	7,236,856	71.95%	720,782	9.96%
(一)店頭市場(OTC)	7,957,638	71.48%	7,236,856	71.95%	720,782	9.96%
1. 遠期契約(Outright Forwards)	1,002,247	9.00%	944,283	9.39%	57,964	6.14%
2. 換匯(Fx Swaps)	5,646,455	50.72%	5,025,739	49.96%	620,716	12.35%
3. 換匯換利(Currency Swaps)	132,599	1.19%	49,021	0.49%	83,578	170.49%
4. 買入選擇權(Bought Options)	583,004	5.24%	608,886	6.05%	-25,882	-4.25%
5. 賣出選擇權(Sold Options)	593,333	5.33%	608,927	6.06%	-15,594	-2.56%
(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)	581,713	5.23%	491,689	4.89%	90,024	18.31%
(一)店頭市場(OTC)	1,931	0.02%	972	0.01%	959	98.66%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	579,782	5.21%	490,717	4.88%	89,065	18.15%
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	55,410	0.50%	61,653	0.61%	-6,243	-10.13%
(一)店頭市場(OTC)	45,749	0.41%	55,582	0.55%	-9,833	-17.69%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	9,661	0.09%	6,071	0.06%	3,590	59.13%
小 計(一至四)	11,078,177	99.52%	10,021,659	99.63%	1,056,518	10.54%
五、信用有關契約(Credit Contracts)	53,868	0.48%	37,329	0.37%	16,539	44.31%
1. 信用違約交換(Credit Default Swap)	53,868	0.48%	37,329	0.37%	16,539	44.31%
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	11,132,045	100.00%	10,058,988	100.00%	1,073,057	10.67%

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。