

銀行衍生性金融商品交易量彙總表

99年1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)	839,117	1,538,868	2,377,985	24.19%
(一)店頭市場(OTC)	839,117	763,251	1,602,368	16.30%
1. 遠期利率協議(FRA)	10,350	-	10,350	0.11%
2. 換利(IRS)	768,774	724,293	1,493,067	15.19%
3. 買入選擇權(Bought Options)	30,765	24,502	55,267	0.56%
4. 賣出選擇權(Sold Options)	29,228	14,456	43,684	0.44%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	775,617	775,617	7.89%
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	-	384,288	384,288	3.91%
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	-	391,329	391,329	3.98%
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)	3,488,665	3,566,543	7,055,208	71.78%
(一)店頭市場(OTC)	3,488,665	3,566,543	7,055,208	71.78%
1. 遠期契約(Outright Forwards)	448,578	412,490	861,068	8.76%
2. 換匯(Fx Swaps)	2,816,518	2,165,424	4,981,942	50.69%
3. 換匯換利(Currency Swaps)	56,671	320	56,991	0.58%
4. 買入選擇權(Bought Options)	83,325	484,195	567,520	5.77%
5. 賣出選擇權(Sold Options)	83,573	504,114	587,687	5.98%
(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)	290,989	3,564	294,553	3.00%
(一)店頭市場(OTC)	437	677	1,114	0.01%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	290,552	2,887	293,439	2.99%
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	953	59,169	60,122	0.61%
(一)店頭市場(OTC)	-	57,940	57,940	0.59%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	953	1,229	2,182	0.02%
小 計(一至四)	4,619,724	5,168,144	9,787,868	99.58%
五、信用有關契約(Credit Contracts)	340	40,529	40,869	0.42%
1. 信用違約交換(Credit Default Swap)	340	40,529	40,869	0.42%
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	4,620,064	5,208,673	9,828,737	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1月份

單位：新臺幣百萬元

商 品 種 類	99年1月		98年12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)	2,377,985	24.19%	1,082,367	12.88%	1,295,618	119.70%
(一)店頭市場(OTC)	1,602,368	16.30%	617,724	7.35%	984,644	159.40%
1. 遠期利率協議(FRA)	10,350	0.11%	-	-	10,350	-
2. 換利(IRS)	1,493,067	15.19%	563,334	6.70%	929,733	165.04%
3. 買入選擇權(Bought Options)	55,267	0.56%	28,528	0.34%	26,739	93.73%
4. 賣出選擇權(Sold Options)	43,684	0.44%	25,862	0.31%	17,822	68.91%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	775,617	7.89%	464,643	5.53%	310,974	66.93%
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	384,288	3.91%	225,547	2.68%	158,741	70.38%
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	391,329	3.98%	238,220	2.84%	153,109	64.27%
3. 買入選擇權(Bought Options)	-	-	876	0.01%	-876	-100.00%
4. 賣出選擇權(Sold Options)	-	-	-	-	-	-
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	7,055,208	71.78%	6,944,166	82.61%	111,042	1.60%
(一)店頭市場(OTC)	7,055,208	71.78%	6,944,166	82.61%	111,042	1.60%
1. 遠期契約(Outright Forwards)	861,068	8.76%	687,800	8.18%	173,268	25.19%
2. 換匯(Fx Swaps)	4,981,942	50.69%	5,390,774	64.13%	-408,832	-7.58%
3. 換匯換利(Currency Swaps)	56,991	0.58%	42,993	0.51%	13,998	32.56%
4. 買入選擇權(Bought Options)	567,520	5.77%	409,363	4.87%	158,157	38.63%
5. 賣出選擇權(Sold Options)	587,687	5.98%	413,236	4.92%	174,451	42.22%
(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)	294,553	3.00%	275,931	3.28%	18,622	6.75%
(一)店頭市場(OTC)	1,114	0.01%	588	0.01%	526	89.46%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	293,439	2.99%	275,343	3.27%	18,096	6.57%
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	60,122	0.61%	93,668	1.11%	-33,546	-35.81%
(一)店頭市場(OTC)	57,940	0.59%	47,896	0.57%	10,044	20.97%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	2,182	0.02%	45,772	0.54%	-43,590	-95.23%
小 計(一至四)	9,787,868	99.58%	8,396,132	99.88%	1,391,736	16.58%
五、信用有關契約(Credit Contracts)	40,869	0.42%	10,129	0.12%	30,740	303.49%
1. 信用違約交換(Credit Default Swap)	40,869	0.42%	10,129	0.12%	30,740	303.49%
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	9,828,737	100.00%	8,406,261	100.00%	1,422,476	16.92%

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。