

銀行衍生性金融商品交易量彙總表

100年7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)	335,750	1,198,921	1,534,671	15.41%
(一)店頭市場(OTC)	335,750	250,602	586,352	5.88%
1. 遠期利率協議(FRA)	300	-	300	-
2. 換利(IRS)	304,980	237,122	542,102	5.45%
3. 買入選擇權(Bought Options)	13,773	4,182	17,955	0.18%
4. 賣出選擇權(Sold Options)	16,697	9,298	25,995	0.25%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	948,319	948,319	9.53%
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	-	435,719	435,719	4.39%
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	-	427,463	427,463	4.29%
3. 買入選擇權(Bought Options)	-	44,826	44,826	0.45%
4. 賣出選擇權(Sold Options)	-	40,311	40,311	0.40%
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	3,380,155	4,533,882	7,914,037	79.49%
(一)店頭市場(OTC)	3,380,155	4,533,882	7,914,037	79.49%
1. 遠期契約(Outright Forwards)	355,600	691,101	1,046,701	10.51%
2. 換匯(Fx Swaps)	2,925,673	2,367,620	5,293,293	53.17%
3. 換匯換利(Currency Swaps)	42,200	16,735	58,935	0.59%
4. 買入選擇權(Bought Options)	32,981	727,027	760,008	7.63%
5. 賣出選擇權(Sold Options)	23,701	731,399	755,100	7.59%
(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)	389,248	23,055	412,303	4.14%
(一)店頭市場(OTC)	3,555	1,841	5,396	0.05%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	385,693	21,214	406,907	4.09%
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	1,296	67,926	69,222	0.70%
(一)店頭市場(OTC)	-	51,690	51,690	0.52%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	1,296	16,236	17,532	0.18%
小 計(一至四)	4,106,449	5,823,784	9,930,233	99.74%
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	25,873	25,873	0.26%
1. 信用違約交換(Credit Default Swap)	-	25,873	25,873	0.26%
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	4,106,449	5,849,657	9,956,106	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

100年7月份

單位：新臺幣百萬元

商 品 種 類	100年7月		100年6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)	1,534,671	15.41%	2,046,398	18.45%	-511,727	-25.01%
(一)店頭市場(OTC)	586,352	5.88%	889,462	8.02%	-303,110	-34.08%
1.遠期利率協議(FRA)	300	-	15,568	0.14%	-15,268	-98.07%
2.換利(IRS)	542,102	5.45%	832,627	7.51%	-290,525	-34.89%
3.買入選擇權(Bought Options)	17,955	0.18%	11,355	0.10%	6,600	58.12%
4.賣出選擇權(Sold Options)	25,995	0.25%	29,912	0.27%	-3,917	-13.10%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	948,319	9.53%	1,156,936	10.43%	-208,617	-18.03%
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	435,719	4.39%	543,715	4.90%	-107,996	-19.86%
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	427,463	4.29%	556,006	5.02%	-128,543	-23.12%
3.買入選擇權(Bought Options)	44,826	0.45%	24,730	0.22%	20,096	81.26%
4.賣出選擇權(Sold Options)	40,311	0.40%	32,485	0.29%	7,826	24.09%
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	7,914,037	79.49%	8,437,078	76.08%	-523,041	-6.20%
(一)店頭市場(OTC)	7,914,037	79.49%	8,437,078	76.08%	-523,041	-6.20%
1.遠期契約(Outright Forwards)	1,046,701	10.51%	817,585	7.37%	229,116	28.02%
2.換匯(Fx Swaps)	5,293,293	53.17%	6,143,572	55.40%	-850,279	-13.84%
3.換匯換利(Currency Swaps)	58,935	0.59%	76,869	0.69%	-17,934	-23.33%
4.買入選擇權(Bought Options)	760,008	7.63%	699,563	6.31%	60,445	8.64%
5.賣出選擇權(Sold Options)	755,100	7.59%	699,489	6.31%	55,611	7.95%
(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)	412,303	4.14%	475,314	4.29%	-63,011	-13.26%
(一)店頭市場(OTC)	5,396	0.05%	9,179	0.08%	-3,783	-41.21%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	406,907	4.09%	466,135	4.21%	-59,228	-12.71%
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	69,222	0.70%	115,298	1.04%	-46,076	-39.96%
(一)店頭市場(OTC)	51,690	0.52%	90,555	0.82%	-38,865	-42.92%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	17,532	0.18%	24,743	0.22%	-7,211	-29.14%
小 計(一至四)	9,930,233	99.74%	11,074,088	99.86%	-1,143,855	-10.33%
五、信用有關契約(Credit Contracts)	25,873	0.26%	15,628	0.14%	10,245	65.56%
1.信用違約交換(Credit Default Swap)	25,873	0.26%	15,628	0.14%	10,245	65.56%
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	9,956,106	100.00%	11,089,716	100.00%	-1,133,610	-10.22%

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。