

# 銀行衍生性金融商品交易量彙總表

100年10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
<b>一、利率有關契約(Interest Rate Contracts)</b>	203,348	567,854	771,202	7.28%
(一)店頭市場(OTC)	203,348	87,572	290,920	2.75%
1.遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-
2.換利(IRS)	191,800	79,080	270,880	2.56%
3.買入選擇權(Bought Options)	4,408	1,250	5,658	0.05%
4.賣出選擇權(Sold Options)	7,140	7,242	14,382	0.14%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	480,282	480,282	4.53%
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	-	226,145	226,145	2.13%
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	-	225,298	225,298	2.13%
3.買入選擇權(Bought Options)	-	14,419	14,419	0.13%
4.賣出選擇權(Sold Options)	-	14,420	14,420	0.14%
<b>二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)</b>	4,288,069	5,164,519	9,452,588	89.26%
(一)店頭市場(OTC)	4,288,069	5,164,519	9,452,588	89.26%
1.遠期契約(Outright Forwards)	567,507	1,039,127	1,606,634	15.17%
2.換匯(Fx Swaps)	3,647,621	2,873,248	6,520,869	61.58%
3.換匯換利(Currency Swaps)	25,221	10,273	35,494	0.33%
4.買入選擇權(Bought Options)	26,005	621,109	647,114	6.11%
5.賣出選擇權(Sold Options)	21,715	620,762	642,477	6.07%
(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)	-	-	-	-
<b>三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)</b>	223,996	21,188	245,184	2.32%
(一)店頭市場(OTC)	2,944	1,199	4,143	0.04%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	221,052	19,989	241,041	2.28%
<b>四、商品有關契約(Commodity Contracts)</b>	1,992	108,158	110,150	1.04%
(一)店頭市場(OTC)	30	93,345	93,375	0.88%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	1,962	14,813	16,775	0.16%
<b>小 計(一至四)</b>	4,717,405	5,861,719	10,579,124	99.90%
<b>五、信用有關契約(Credit Contracts)</b>	-	10,468	10,468	0.10%
1.信用違約交換(Credit Default Swap)	-	10,468	10,468	0.10%
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)	-	-	-	-
<b>六、其他有關契約(Other Contracts)</b>	-	-	-	-
1.遠期契約(Outright Forwards)	-	-	-	-
2.交換(Swaps)	-	-	-	-
3.選擇權(Options)	-	-	-	-
<b>總 計</b>	4,717,405	5,872,187	10,589,592	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10月份

單位：新臺幣百萬元

商品種類	100年10月		100年9月		比較增減	
	合計	百分比	合計	百分比	合計	百分比
<b>一、利率有關契約(Interest Rate Contracts)</b>	771,202	7.28%	987,897	8.54%	-216,695	-21.93%
(一)店頭市場(OTC)	290,920	2.75%	281,399	2.44%	9,521	3.38%
1. 遠期利率協議(FRA)	-	-	3,048	0.03%	-3,048	-100.00%
2. 換利(IRS)	270,880	2.56%	263,435	2.28%	7,445	2.83%
3. 買入選擇權(Bought Options)	5,658	0.05%	4,263	0.04%	1,395	32.72%
4. 賣出選擇權(Sold Options)	14,382	0.14%	10,653	0.09%	3,729	35.00%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	480,282	4.53%	706,498	6.10%	-226,216	-32.02%
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	226,145	2.13%	350,373	3.02%	-124,228	-35.46%
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	225,298	2.13%	348,181	3.01%	-122,883	-35.29%
3. 買入選擇權(Bought Options)	14,419	0.13%	-	-	14,419	0.00%
4. 賣出選擇權(Sold Options)	14,420	0.14%	7,944	0.07%	6,476	81.52%
<b>二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)</b>	9,452,588	89.26%	10,107,235	87.32%	-654,647	-6.48%
(一)店頭市場(OTC)	9,452,588	89.26%	10,107,235	87.32%	-654,647	-6.48%
1. 遠期契約(Outright Forwards)	1,606,634	15.17%	1,688,864	14.59%	-82,230	-4.87%
2. 換匯(Fx Swaps)	6,520,869	61.58%	6,894,777	59.57%	-373,908	-5.42%
3. 換匯換利(Currency Swaps)	35,494	0.33%	46,936	0.40%	-11,442	-24.38%
4. 買入選擇權(Bought Options)	647,114	6.11%	738,518	6.38%	-91,404	-12.38%
5. 賣出選擇權(Sold Options)	642,477	6.07%	738,140	6.38%	-95,663	-12.96%
(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)	-	-	-	-	-	-
<b>三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)</b>	245,184	2.32%	373,208	3.23%	-128,024	-34.30%
(一)店頭市場(OTC)	4,143	0.04%	5,832	0.05%	-1,689	-28.96%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	241,041	2.28%	367,376	3.18%	-126,335	-34.39%
<b>四、商品有關契約(Commodity Contracts)</b>	110,150	1.04%	88,328	0.76%	21,822	24.71%
(一)店頭市場(OTC)	93,375	0.88%	61,683	0.53%	31,692	51.38%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	16,775	0.16%	26,645	0.23%	-9,870	-37.04%
<b>小計(一至四)</b>	10,579,124	99.90%	11,556,668	99.85%	-977,544	-8.46%
<b>五、信用有關契約(Credit Contracts)</b>	10,468	0.10%	18,170	0.15%	-7,702	-42.39%
1. 信用違約交換(Credit Default Swap)	10,468	0.10%	18,170	0.15%	-7,702	-42.39%
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)	-	-	-	-	-	-
<b>六、其他有關契約(Other Contracts)</b>	-	-	-	-	-	-
1. 遠期契約(Outright Forwards)	-	-	-	-	-	-
2. 交換(Swaps)	-	-	-	-	-	-
3. 選擇權(Options)	-	-	-	-	-	-
<b>總計</b>	10,589,592	100.00%	11,574,838	100.00%	-985,246	-8.51%

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。