

銀行衍生性金融商品交易量彙總表

100年2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)	500,925	1,628,021	2,128,946	24.50%
(一)店頭市場(OTC)	500,925	437,951	938,876	10.80%
1. 遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-
2. 換利(IRS)	453,287	431,918	885,205	10.19%
3. 買入選擇權(Bought Options)	22,464	427	22,891	0.26%
4. 賣出選擇權(Sold Options)	25,174	5,606	30,780	0.35%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	1,190,070	1,190,070	13.70%
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	-	572,468	572,468	6.59%
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	-	579,250	579,250	6.67%
3. 買入選擇權(Bought Options)	-	15,631	15,631	0.18%
4. 賣出選擇權(Sold Options)	-	22,721	22,721	0.26%
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	2,972,564	2,776,146	5,748,710	66.16%
(一)店頭市場(OTC)	2,972,564	2,776,146	5,748,710	66.16%
1. 遠期契約(Outright Forwards)	347,472	268,094	615,566	7.08%
2. 換匯(Fx Swaps)	2,540,655	1,722,189	4,262,844	49.06%
3. 換匯換利(Currency Swaps)	37,353	8,319	45,672	0.53%
4. 買入選擇權(Bought Options)	23,610	390,864	414,474	4.77%
5. 賣出選擇權(Sold Options)	23,474	386,680	410,154	4.72%
(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)	674,511	6,996	681,507	7.84%
(一)店頭市場(OTC)	827	197	1,024	0.01%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	673,684	6,799	680,483	7.83%
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	1,342	123,516	124,858	1.44%
(一)店頭市場(OTC)	-	34,022	34,022	0.39%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	1,342	89,494	90,836	1.05%
小 計(一至四)	4,149,342	4,534,679	8,684,021	99.94%
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	5,621	5,621	0.06%
1. 信用違約交換(Credit Default Swap)	-	5,621	5,621	0.06%
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	4,149,342	4,540,300	8,689,642	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2月份

單位：新臺幣百萬元

商 品 種 類	100年2月		100年1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)	2,128,946	24.50%	1,884,214	18.21%	244,732	12.99%
(一)店頭市場(OTC)	938,876	10.80%	633,307	6.12%	305,569	48.25%
1. 遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-	-	0.00%
2. 換利(IRS)	885,205	10.19%	573,631	5.54%	311,574	54.32%
3. 買入選擇權(Bought Options)	22,891	0.26%	24,543	0.24%	-1,652	-6.73%
4. 賣出選擇權(Sold Options)	30,780	0.35%	35,133	0.34%	-4,353	-12.39%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	1,190,070	13.70%	1,250,907	12.09%	-60,837	-4.86%
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	572,468	6.59%	605,714	5.85%	-33,246	-5.49%
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	579,250	6.67%	606,883	5.87%	-27,633	-4.55%
3. 買入選擇權(Bought Options)	15,631	0.18%	18,764	0.18%	-3,133	-16.70%
4. 賣出選擇權(Sold Options)	22,721	0.26%	19,546	0.19%	3,175	16.24%
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	5,748,710	66.16%	7,804,101	75.41%	-2,055,391	-26.34%
(一)店頭市場(OTC)	5,748,710	66.16%	7,804,101	75.41%	-2,055,391	-26.34%
1. 遠期契約(Outright Forwards)	615,566	7.08%	741,351	7.16%	-125,785	-16.97%
2. 換匯(Fx Swaps)	4,262,844	49.06%	5,821,250	56.25%	-1,558,406	-26.77%
3. 換匯換利(Currency Swaps)	45,672	0.53%	63,959	0.62%	-18,287	-28.59%
4. 買入選擇權(Bought Options)	414,474	4.77%	589,367	5.70%	-174,893	-29.67%
5. 賣出選擇權(Sold Options)	410,154	4.72%	588,174	5.68%	-178,020	-30.27%
(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)	681,507	7.84%	556,666	5.38%	124,841	22.43%
(一)店頭市場(OTC)	1,024	0.01%	2,648	0.03%	-1,624	-61.33%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	680,483	7.83%	554,018	5.35%	126,465	22.83%
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	124,858	1.44%	85,400	0.82%	39,458	46.20%
(一)店頭市場(OTC)	34,022	0.39%	54,432	0.52%	-20,410	-37.50%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	90,836	1.05%	30,968	0.30%	59,868	193.32%
小 計(一至四)	8,684,021	99.94%	10,330,381	99.82%	-1,646,360	-15.94%
五、信用有關契約(Credit Contracts)	5,621	0.06%	18,170	0.18%	-12,549	-69.06%
1. 信用違約交換(Credit Default Swap)	5,621	0.06%	18,170	0.18%	-12,549	-69.06%
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	8,689,642	100.00%	10,348,551	100.00%	-1,658,909	-16.03%

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。