

銀行衍生性金融商品交易量彙總表

100年9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)	214,477	773,420	987,897	8.54%
(一)店頭市場(OTC)	214,477	66,922	281,399	2.44%
1. 遠期利率協議(FRA)	-	3,048	3,048	0.03%
2. 換利(IRS)	203,205	60,230	263,435	2.28%
3. 買入選擇權(Bought Options)	4,179	84	4,263	0.04%
4. 賣出選擇權(Sold Options)	7,093	3,560	10,653	0.09%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	706,498	706,498	6.10%
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	-	350,373	350,373	3.02%
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	-	348,181	348,181	3.01%
3. 買入選擇權(Bought Options)	-	-	-	-
4. 賣出選擇權(Sold Options)	-	7,944	7,944	0.07%
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	4,553,914	5,553,321	10,107,235	87.32%
(一)店頭市場(OTC)	4,553,914	5,553,321	10,107,235	87.32%
1. 遠期契約(Outright Forwards)	526,171	1,162,693	1,688,864	14.59%
2. 換匯(Fx Swaps)	3,891,493	3,003,284	6,894,777	59.57%
3. 換匯換利(Currency Swaps)	29,278	17,658	46,936	0.40%
4. 買入選擇權(Bought Options)	51,564	686,954	738,518	6.38%
5. 賣出選擇權(Sold Options)	55,408	682,732	738,140	6.38%
(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)	331,331	41,877	373,208	3.23%
(一)店頭市場(OTC)	5,688	144	5,832	0.05%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	325,643	41,733	367,376	3.18%
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	1,607	86,721	88,328	0.76%
(一)店頭市場(OTC)	-	61,683	61,683	0.53%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	1,607	25,038	26,645	0.23%
小 計(一至四)	5,101,329	6,455,339	11,556,668	99.85%
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	18,170	18,170	0.15%
1. 信用違約交換(Credit Default Swap)	-	18,170	18,170	0.15%
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	5,101,329	6,473,509	11,574,838	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9月份

單位：新臺幣百萬元

商 品 種 類	100年9月		100年8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)	987,897	8.54%	1,788,184	14.59%	-800,287	-44.75%
(一)店頭市場(OTC)	281,399	2.44%	711,772	5.81%	-430,373	-60.47%
1.遠期利率協議(FRA)	3,048	0.03%	-	-	3,048	0.00%
2.換利(IRS)	263,435	2.28%	691,639	5.64%	-428,204	-61.91%
3.買入選擇權(Bought Options)	4,263	0.04%	5,688	0.05%	-1,425	-25.05%
4.賣出選擇權(Sold Options)	10,653	0.09%	14,445	0.12%	-3,792	-26.25%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	706,498	6.10%	1,076,412	8.78%	-369,914	-34.37%
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	350,373	3.02%	545,081	4.45%	-194,708	-35.72%
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	348,181	3.01%	523,602	4.27%	-175,421	-33.50%
3.買入選擇權(Bought Options)	-	-	7,439	0.06%	-7,439	-100.00%
4.賣出選擇權(Sold Options)	7,944	0.07%	290	-	7,654	2639.31%
二、匯率有關契約 (Foreign Exchange Transactions)	10,107,235	87.32%	9,818,425	80.10%	288,810	2.94%
(一)店頭市場(OTC)	10,107,235	87.32%	9,818,425	80.10%	288,810	2.94%
1.遠期契約(Outright Forwards)	1,688,864	14.59%	1,402,325	11.44%	286,539	20.43%
2.換匯(Fx Swaps)	6,894,777	59.57%	6,621,133	54.02%	273,644	4.13%
3.換匯換利(Currency Swaps)	46,936	0.40%	95,935	0.78%	-48,999	-51.08%
4.買入選擇權(Bought Options)	738,518	6.38%	854,055	6.97%	-115,537	-13.53%
5.賣出選擇權(Sold Options)	738,140	6.38%	844,977	6.89%	-106,837	-12.64%
(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)	373,208	3.23%	553,406	4.51%	-180,198	-32.56%
(一)店頭市場(OTC)	5,832	0.05%	2,183	0.02%	3,649	167.16%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	367,376	3.18%	551,223	4.49%	-183,847	-33.35%
四、商品有關契約 (Commodity Contracts)	88,328	0.76%	85,450	0.70%	2,878	3.37%
(一)店頭市場(OTC)	61,683	0.53%	62,511	0.51%	-828	-1.32%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	26,645	0.23%	22,939	0.19%	3,706	16.16%
小 計(一至四)	11,556,668	99.85%	12,245,465	99.90%	-688,797	-5.62%
五、信用有關契約 (Credit Contracts)	18,170	0.15%	12,553	0.10%	5,617	44.75%
1.信用違約交換(Credit Default Swap)	18,170	0.15%	12,553	0.10%	5,617	44.75%
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	11,574,838	100.00%	12,258,018	100.00%	-683,180	-5.57%

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。