

銀行衍生性金融商品交易量彙總表

101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)	392,313	493,811	886,124	10.42%
(一)店頭市場(OTC)	392,313	140,132	532,445	6.26%
1. 遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-
2. 換利(IRS)	385,218	116,173	501,391	5.89%
3. 買入選擇權(Bought Options)	3,747	3,520	7,267	0.09%
4. 賣出選擇權(Sold Options)	3,348	20,439	23,787	0.28%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	353,679	353,679	4.16%
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	-	160,594	160,594	1.89%
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	-	193,085	193,085	2.27%
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)	3,676,903	3,708,392	7,385,295	86.80%
(一)店頭市場(OTC)	3,676,903	3,708,392	7,385,295	86.80%
1. 遠期契約(Outright Forwards)	357,467	644,909	1,002,376	11.78%
2. 換匯(Fx Swaps)	3,182,034	1,878,206	5,060,240	59.48%
3. 換匯換利(Currency Swaps)	59,187	1,184	60,371	0.71%
4. 買入選擇權(Bought Options)	41,758	586,547	628,305	7.38%
5. 賣出選擇權(Sold Options)	36,457	597,546	634,003	7.45%
(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)	168,325	11,352	179,677	2.11%
(一)店頭市場(OTC)	852	864	1,716	0.02%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	167,473	10,488	177,961	2.09%
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	1,303	49,320	50,623	0.60%
(一)店頭市場(OTC)	-	40,106	40,106	0.47%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	1,303	9,214	10,517	0.13%
小 計(一至四)	4,238,844	4,262,875	8,501,719	99.93%
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	6,299	6,299	0.07%
1. 信用違約交換(Credit Default Swap)	-	6,299	6,299	0.07%
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	4,238,844	4,269,174	8,508,018	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

101年1月份

單位：新臺幣百萬元

商 品 種 類	101年1月		100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)	886,124	10.42%	710,861	7.93%	175,263	24.66%
(一)店頭市場(OTC)	532,445	6.26%	345,246	3.85%	187,199	54.22%
1. 遠期利率協議(FRA)	-	-	17,081	0.19%	-17,081	-100.00%
2. 換利(IRS)	501,391	5.89%	307,964	3.44%	193,427	62.81%
3. 買入選擇權(Bought Options)	7,267	0.09%	7,457	0.08%	-190	-2.55%
4. 賣出選擇權(Sold Options)	23,787	0.28%	12,744	0.14%	11,043	86.65%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	353,679	4.16%	365,615	4.08%	-11,936	-3.26%
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	160,594	1.89%	163,701	1.83%	-3,107	-1.90%
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	193,085	2.27%	201,914	2.25%	-8,829	-4.37%
3. 買入選擇權(Bought Options)	-	-	-	-	-	0.00%
4. 賣出選擇權(Sold Options)	-	-	-	-	-	0.00%
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	7,385,295	86.80%	7,979,268	88.97%	-593,973	-7.44%
(一)店頭市場(OTC)	7,385,295	86.80%	7,979,268	88.97%	-593,973	-7.44%
1. 遠期契約(Outright Forwards)	1,002,376	11.78%	940,350	10.48%	62,026	6.60%
2. 換匯(Fx Swaps)	5,060,240	59.48%	5,987,333	66.76%	-927,093	-15.48%
3. 換匯換利(Currency Swaps)	60,371	0.71%	42,702	0.48%	17,669	41.38%
4. 買入選擇權(Bought Options)	628,305	7.38%	494,436	5.51%	133,869	27.08%
5. 賣出選擇權(Sold Options)	634,003	7.45%	514,447	5.74%	119,556	23.24%
(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)	179,677	2.11%	229,500	2.56%	-49,823	-21.71%
(一)店頭市場(OTC)	1,716	0.02%	4,199	0.05%	-2,483	-59.13%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	177,961	2.09%	225,301	2.51%	-47,340	-21.01%
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	50,623	0.60%	45,633	0.51%	4,990	10.94%
(一)店頭市場(OTC)	40,106	0.47%	38,527	0.43%	1,579	4.10%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	10,517	0.13%	7,106	0.08%	3,411	48.00%
小 計(一至四)	8,501,719	99.93%	8,965,262	99.97%	-463,543	-5.17%
五、信用有關契約(Credit Contracts)	6,299	0.07%	2,992	0.03%	3,307	110.53%
1. 信用違約交換(Credit Default Swap)	6,299	0.07%	2,992	0.03%	3,307	110.53%
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	8,508,018	100.00%	8,968,254	100.00%	-460,236	-5.13%

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。

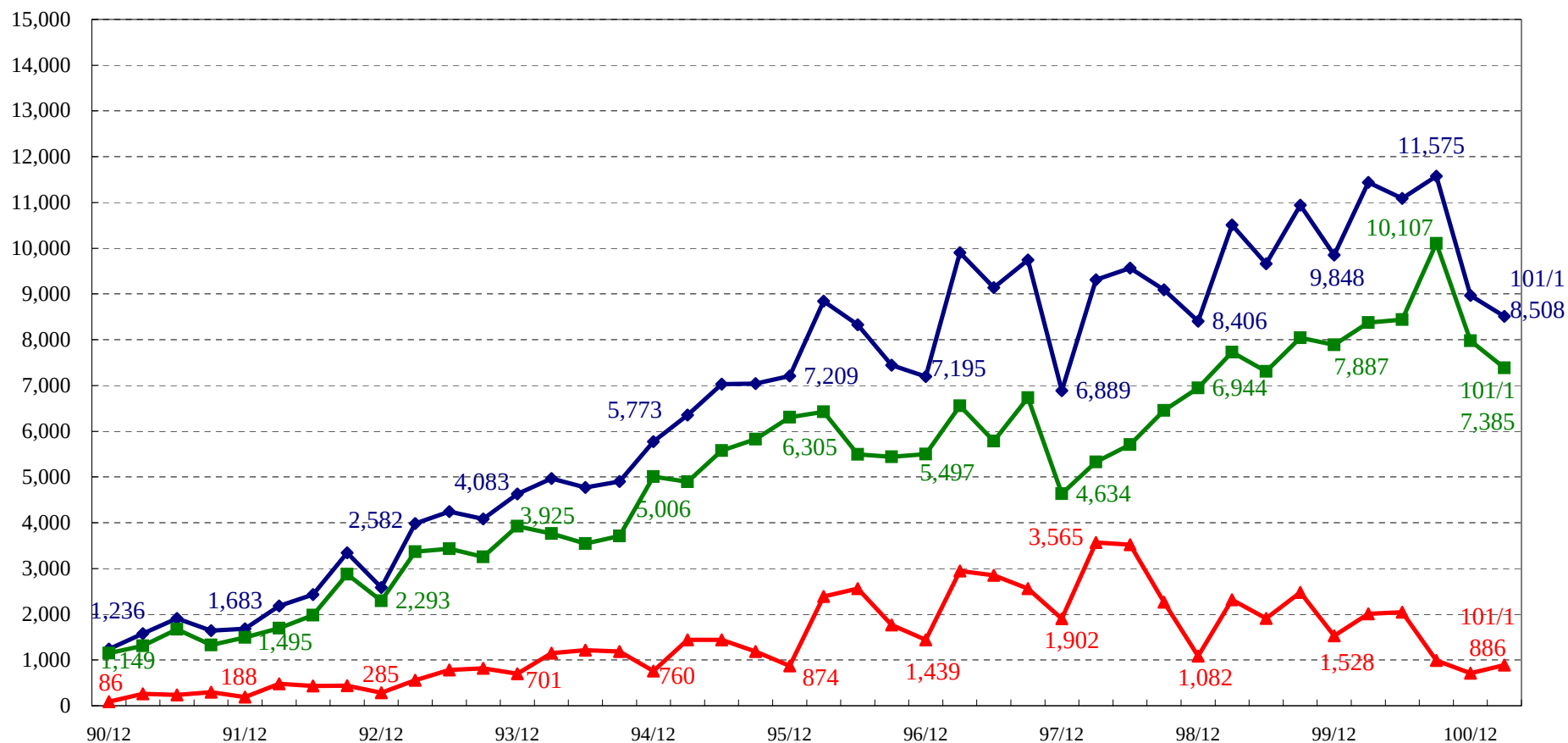
3. 「匯率有關—遠期契約」中「涉及新臺幣交易」金額包括新臺幣對外幣無本金交割遠期外匯交易；「純外幣交易」金額包括外幣保證金交易以遠期契約承作者。

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。

101年1銀行辦理衍生性金融商品交易量統計(附圖1)

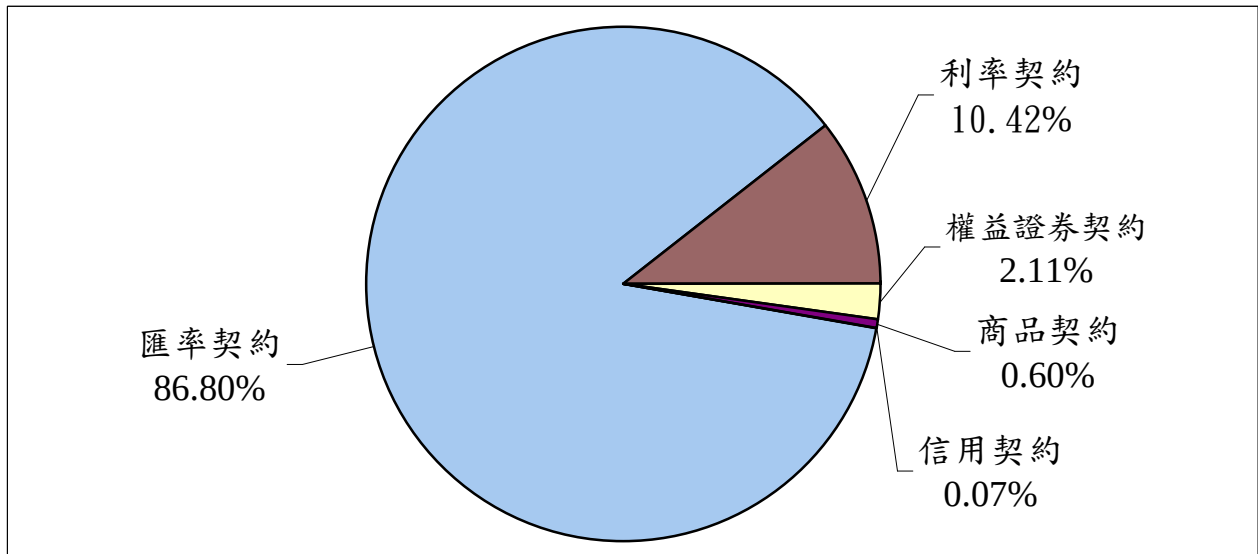
新臺幣十億元

◆ 總交易量 ■ 匯率有關契約 ▲ 利率有關契約

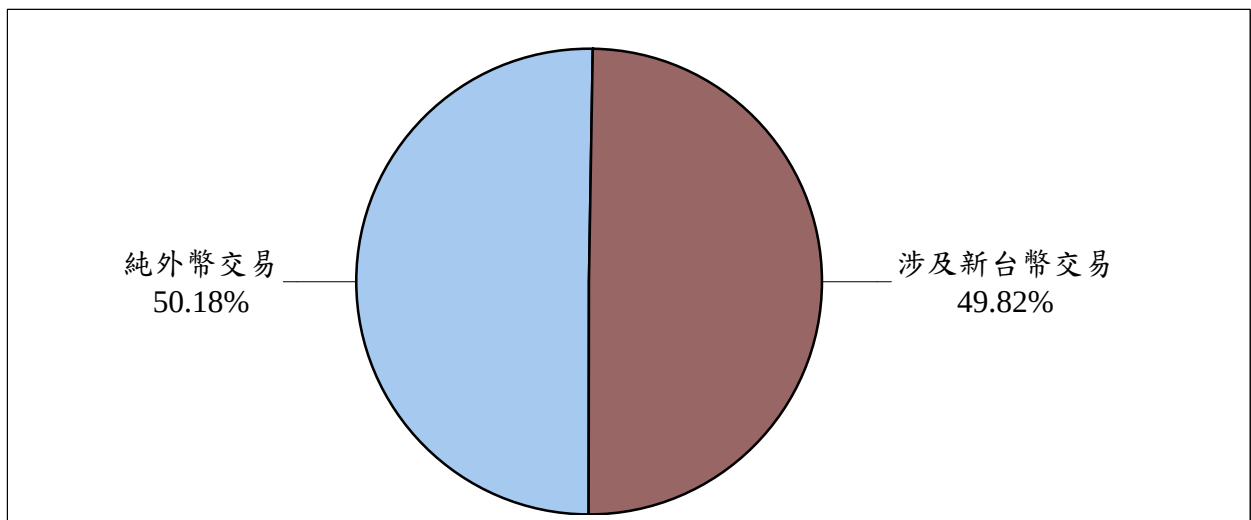


101年1月銀行衍生性金融商品交易量內容分析(附圖2)

商品種類別



幣別



銀行類別

