

銀行衍生性金融商品交易量彙總表

100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)	373,087	1,511,127	1,884,214	18.21%
(一)店頭市場(OTC)	373,087	260,220	633,307	6.12%
1. 遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-
2. 換利(IRS)	324,929	248,702	573,631	5.54%
3. 買入選擇權(Bought Options)	22,283	2,260	24,543	0.24%
4. 賣出選擇權(Sold Options)	25,875	9,258	35,133	0.34%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	1,250,907	1,250,907	12.09%
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	-	605,714	605,714	5.85%
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	-	606,883	606,883	5.87%
3. 買入選擇權(Bought Options)	-	18,764	18,764	0.18%
4. 賣出選擇權(Sold Options)	-	19,546	19,546	0.19%
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	3,920,396	3,883,705	7,804,101	75.41%
(一)店頭市場(OTC)	3,920,396	3,883,705	7,804,101	75.41%
1. 遠期契約(Outright Forwards)	355,255	386,096	741,351	7.16%
2. 換匯(Fx Swaps)	3,462,849	2,358,401	5,821,250	56.25%
3. 換匯換利(Currency Swaps)	42,954	21,005	63,959	0.62%
4. 買入選擇權(Bought Options)	29,453	559,914	589,367	5.70%
5. 賣出選擇權(Sold Options)	29,885	558,289	588,174	5.68%
(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)	548,915	7,751	556,666	5.38%
(一)店頭市場(OTC)	1,298	1,350	2,648	0.03%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	547,617	6,401	554,018	5.35%
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	1,894	83,506	85,400	0.82%
(一)店頭市場(OTC)	-	54,432	54,432	0.52%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	1,894	29,074	30,968	0.30%
小 計(一至四)	4,844,292	5,486,089	10,330,381	99.82%
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	18,170	18,170	0.18%
1. 信用違約交換(Credit Default Swap)	-	18,170	18,170	0.18%
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	4,844,292	5,504,259	10,348,551	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1月份

單位：新臺幣百萬元

商 品 種 類	100年1月		99年12月		比較增減	
	台外幣合計	百分比	台外幣合計	百分比	差 額	百分比
一、利率有關契約(Interest Rate Contracts)	1,884,214	18.21%	1,528,451	15.52%	355,763	23.28%
(一)店頭市場(OTC)	633,307	6.12%	339,434	3.45%	293,873	86.58%
1. 遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-	-	-
2. 換利(IRS)	573,631	5.54%	305,422	3.10%	268,209	87.82%
3. 買入選擇權(Bought Options)	24,543	0.24%	12,201	0.13%	12,342	101.16%
4. 賣出選擇權(Sold Options)	35,133	0.34%	21,811	0.22%	13,322	61.08%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	1,250,907	12.09%	1,189,017	12.07%	61,890	5.21%
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	605,714	5.85%	570,991	5.80%	34,723	6.08%
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	606,883	5.87%	598,459	6.08%	8,424	1.41%
3. 買入選擇權(Bought Options)	18,764	0.18%	7,500	0.07%	11,264	150.19%
4. 賣出選擇權(Sold Options)	19,546	0.19%	12,067	0.12%	7,479	61.98%
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	7,804,101	75.41%	7,887,411	80.09%	-83,310	-1.06%
(一)店頭市場(OTC)	7,804,101	75.41%	7,887,411	80.09%	-83,310	-1.06%
1. 遠期契約(Outright Forwards)	741,351	7.16%	711,521	7.23%	29,830	4.19%
2. 換匯(Fx Swaps)	5,821,250	56.25%	6,187,369	62.83%	-366,119	-5.92%
3. 換匯換利(Currency Swaps)	63,959	0.62%	30,565	0.31%	33,394	109.26%
4. 買入選擇權(Bought Options)	589,367	5.70%	484,931	4.92%	104,436	21.54%
5. 賣出選擇權(Sold Options)	588,174	5.68%	473,025	4.80%	115,149	24.34%
(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)	556,666	5.38%	374,980	3.81%	181,686	48.45%
(一)店頭市場(OTC)	2,648	0.03%	571	0.01%	2,077	363.75%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	554,018	5.35%	374,409	3.80%	179,609	47.97%
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	85,400	0.82%	54,364	0.55%	31,036	57.09%
(一)店頭市場(OTC)	54,432	0.52%	48,520	0.49%	5,912	12.18%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	30,968	0.30%	5,844	0.06%	25,124	429.91%
小 計(一至四)	10,330,381	99.82%	9,845,206	99.97%	485,175	4.93%
五、信用有關契約(Credit Contracts)	18,170	0.18%	2,989	0.03%	15,181	507.90%
1. 信用違約交換(Credit Default Swap)	18,170	0.18%	2,989	0.03%	15,181	507.90%
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	10,348,551	100.00%	9,848,195	100.00%	500,356	5.08%

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。