

銀行衍生性金融商品交易量彙總表

100年8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)	498,290	1,289,894	1,788,184	14.59%
(一)店頭市場(OTC)	498,290	213,482	711,772	5.81%
1. 遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-
2. 換利(IRS)	483,731	207,908	691,639	5.64%
3. 買入選擇權(Bought Options)	5,688	-	5,688	0.05%
4. 賣出選擇權(Sold Options)	8,871	5,574	14,445	0.12%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	1,076,412	1,076,412	8.78%
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	-	545,081	545,081	4.45%
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	-	523,602	523,602	4.27%
3. 買入選擇權(Bought Options)	-	7,439	7,439	0.06%
4. 賣出選擇權(Sold Options)	-	290	290	-
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	4,000,043	5,818,382	9,818,425	80.10%
(一)店頭市場(OTC)	4,000,043	5,818,382	9,818,425	80.10%
1. 遠期契約(Outright Forwards)	475,050	927,275	1,402,325	11.44%
2. 換匯(Fx Swaps)	3,384,439	3,236,694	6,621,133	54.02%
3. 換匯換利(Currency Swaps)	75,309	20,626	95,935	0.78%
4. 買入選擇權(Bought Options)	34,471	819,584	854,055	6.97%
5. 賣出選擇權(Sold Options)	30,774	814,203	844,977	6.89%
(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)	510,836	42,570	553,406	4.51%
(一)店頭市場(OTC)	1,495	688	2,183	0.02%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	509,341	41,882	551,223	4.49%
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	2,700	82,750	85,450	0.70%
(一)店頭市場(OTC)	-	62,511	62,511	0.51%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	2,700	20,239	22,939	0.19%
小 計(一至四)	5,011,869	7,233,596	12,245,465	99.90%
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	12,553	12,553	0.10%
1. 信用違約交換(Credit Default Swap)	-	12,553	12,553	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)	-	-	-	-
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	5,011,869	7,246,149	12,258,018	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

100年8月份

單位：新臺幣百萬元

商 品 種 類	100年8月		100年7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)	1,788,184	14.59%	1,534,671	15.41%	253,513	16.52%
(一)店頭市場(OTC)	711,772	5.81%	586,352	5.88%	125,420	21.39%
1.遠期利率協議(FRA)	-	-	300	-	-300	-100.00%
2.換利(IRS)	691,639	5.64%	542,102	5.45%	149,537	27.58%
3.買入選擇權(Bought Options)	5,688	0.05%	17,955	0.18%	-12,267	-68.32%
4.賣出選擇權(Sold Options)	14,445	0.12%	25,995	0.25%	-11,550	-44.43%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	1,076,412	8.78%	948,319	9.53%	128,093	13.51%
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	545,081	4.45%	435,719	4.39%	109,362	25.10%
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	523,602	4.27%	427,463	4.29%	96,139	22.49%
3.買入選擇權(Bought Options)	7,439	0.06%	44,826	0.45%	-37,387	-83.40%
4.賣出選擇權(Sold Options)	290	-	40,311	0.40%	-40,021	-99.28%
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	9,818,425	80.10%	7,914,037	79.49%	1,904,388	24.06%
(一)店頭市場(OTC)	9,818,425	80.10%	7,914,037	79.49%	1,904,388	24.06%
1.遠期契約(Outright Forwards)	1,402,325	11.44%	1,046,701	10.51%	355,624	33.98%
2.換匯(Fx Swaps)	6,621,133	54.02%	5,293,293	53.17%	1,327,840	25.09%
3.換匯換利(Currency Swaps)	95,935	0.78%	58,935	0.59%	37,000	62.78%
4.買入選擇權(Bought Options)	854,055	6.97%	760,008	7.63%	94,047	12.37%
5.賣出選擇權(Sold Options)	844,977	6.89%	755,100	7.59%	89,877	11.90%
(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)	553,406	4.51%	412,303	4.14%	141,103	34.22%
(一)店頭市場(OTC)	2,183	0.02%	5,396	0.05%	-3,213	-59.54%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	551,223	4.49%	406,907	4.09%	144,316	35.47%
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	85,450	0.70%	69,222	0.70%	16,228	23.44%
(一)店頭市場(OTC)	62,511	0.51%	51,690	0.52%	10,821	20.93%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	22,939	0.19%	17,532	0.18%	5,407	30.84%
小 計(一至四)	12,245,465	99.90%	9,930,233	99.74%	2,315,232	23.31%
五、信用有關契約(Credit Contracts)	12,553	0.10%	25,873	0.26%	-13,320	-51.48%
1.信用違約交換(Credit Default Swap)	12,553	0.10%	25,873	0.26%	-13,320	-51.48%
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	12,258,018	100.00%	9,956,106	100.00%	2,301,912	23.12%

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。