

銀行衍生性金融商品交易量彙總表

100年12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)	242,062	468,799	710,861	7.93%
(一)店頭市場(OTC)	242,062	103,184	345,246	3.85%
1. 遠期利率協議(FRA)	130	16,951	17,081	0.19%
2. 換利(IRS)	227,677	80,287	307,964	3.44%
3. 買入選擇權(Bought Options)	7,384	73	7,457	0.08%
4. 賣出選擇權(Sold Options)	6,871	5,873	12,744	0.14%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	365,615	365,615	4.08%
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	-	163,701	163,701	1.83%
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	-	201,914	201,914	2.25%
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)	3,988,979	3,990,289	7,979,268	88.97%
(一)店頭市場(OTC)	3,988,979	3,990,289	7,979,268	88.97%
1. 遠期契約(Outright Forwards)	260,473	679,877	940,350	10.48%
2. 換匯(Fx Swaps)	3,570,753	2,416,580	5,987,333	66.76%
3. 換匯換利(Currency Swaps)	41,793	909	42,702	0.48%
4. 買入選擇權(Bought Options)	53,359	441,077	494,436	5.51%
5. 賣出選擇權(Sold Options)	62,601	451,846	514,447	5.74%
(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)	221,596	7,904	229,500	2.56%
(一)店頭市場(OTC)	3,973	226	4,199	0.05%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	217,623	7,678	225,301	2.51%
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	2,094	43,539	45,633	0.51%
(一)店頭市場(OTC)	-	38,527	38,527	0.43%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	2,094	5,012	7,106	0.08%
小 計(一至四)	4,454,731	4,510,531	8,965,262	99.97%
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	2,992	2,992	0.03%
1. 信用違約交換(Credit Default Swap)	-	2,992	2,992	0.03%
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	4,454,731	4,513,523	8,968,254	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12月份

單位：新臺幣百萬元

商 品 種 類	100年12月		100年11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)	710,861	7.93%	817,422	8.09%	-106,561	-13.04%
(一)店頭市場(OTC)	345,246	3.85%	233,264	2.31%	111,982	48.01%
1. 遠期利率協議(FRA)	17,081	0.19%	-	-	17,081	0.00%
2. 換利(IRS)	307,964	3.44%	211,714	2.10%	96,250	45.46%
3. 買入選擇權(Bought Options)	7,457	0.08%	8,193	0.08%	-736	-8.98%
4. 賣出選擇權(Sold Options)	12,744	0.14%	13,357	0.13%	-613	-4.59%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	365,615	4.08%	584,158	5.78%	-218,543	-37.41%
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	163,701	1.83%	304,473	3.01%	-140,772	-46.23%
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	201,914	2.25%	279,685	2.77%	-77,771	-27.81%
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)	7,979,268	88.97%	8,928,983	88.32%	-949,715	-10.64%
(一)店頭市場(OTC)	7,979,268	88.97%	8,928,983	88.32%	-949,715	-10.64%
1. 遠期契約(Outright Forwards)	940,350	10.48%	1,248,491	12.35%	-308,141	-24.68%
2. 換匯(Fx Swaps)	5,987,333	66.76%	6,285,623	62.17%	-298,290	-4.75%
3. 換匯換利(Currency Swaps)	42,702	0.48%	56,993	0.57%	-14,291	-25.08%
4. 買入選擇權(Bought Options)	494,436	5.51%	669,242	6.62%	-174,806	-26.12%
5. 賣出選擇權(Sold Options)	514,447	5.74%	668,634	6.61%	-154,187	-23.06%
(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)	229,500	2.56%	297,374	2.94%	-67,874	-22.82%
(一)店頭市場(OTC)	4,199	0.05%	6,990	0.07%	-2,791	-39.93%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	225,301	2.51%	290,384	2.87%	-65,083	-22.41%
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	45,633	0.51%	49,772	0.49%	-4,139	-8.32%
(一)店頭市場(OTC)	38,527	0.43%	42,195	0.42%	-3,668	-8.69%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	7,106	0.08%	7,577	0.07%	-471	-6.22%
小 計(一至四)	8,965,262	99.97%	10,093,551	99.84%	-1,128,289	-11.18%
五、信用有關契約(Credit Contracts)	2,992	0.03%	16,669	0.16%	-13,677	-82.05%
1. 信用違約交換(Credit Default Swap)	2,992	0.03%	16,669	0.16%	-13,677	-82.05%
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	8,968,254	100.00%	10,110,220	100.00%	-1,141,966	-11.30%

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。