

銀行衍生性金融商品交易量彙總表

100年5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)	409,996	1,010,832	1,420,828	14.64%
(一)店頭市場(OTC)	409,996	162,368	572,364	5.90%
1. 遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-
2. 換利(IRS)	381,314	159,455	540,769	5.57%
3. 買入選擇權(Bought Options)	14,236	140	14,376	0.15%
4. 賣出選擇權(Sold Options)	14,446	2,773	17,219	0.18%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	848,464	848,464	8.74%
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	-	391,114	391,114	4.03%
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	-	411,745	411,745	4.24%
3. 買入選擇權(Bought Options)	-	10,006	10,006	0.10%
4. 賣出選擇權(Sold Options)	-	35,599	35,599	0.37%
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	3,304,159	4,271,323	7,575,482	78.07%
(一)店頭市場(OTC)	3,304,159	4,271,323	7,575,482	78.07%
1. 遠期契約(Outright Forwards)	353,094	465,009	818,103	8.43%
2. 換匯(Fx Swaps)	2,850,246	2,425,224	5,275,470	54.37%
3. 換匯換利(Currency Swaps)	36,548	12,664	49,212	0.51%
4. 買入選擇權(Bought Options)	34,210	687,150	721,360	7.43%
5. 賣出選擇權(Sold Options)	30,061	681,276	711,337	7.33%
(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)	591,588	25,591	617,179	6.37%
(一)店頭市場(OTC)	5,068	774	5,842	0.06%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	586,520	24,817	611,337	6.31%
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	1,058	78,831	79,889	0.82%
(一)店頭市場(OTC)	-	55,990	55,990	0.58%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	1,058	22,841	23,899	0.24%
小 計(一至四)	4,306,801	5,386,577	9,693,378	99.90%
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	9,777	9,777	0.10%
1. 信用違約交換(Credit Default Swap)	-	9,777	9,777	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	4,306,801	5,396,354	9,703,155	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5月份

單位：新臺幣百萬元

商 品 種 類	100年5月		100年4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)	1,420,828	14.64%	1,208,170	13.08%	212,658	17.60%
(一)店頭市場(OTC)	572,364	5.90%	400,588	4.34%	171,776	42.88%
1.遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-	-	0.00%
2.換利(IRS)	540,769	5.57%	363,399	3.94%	177,370	48.81%
3.買入選擇權(Bought Options)	14,376	0.15%	18,655	0.20%	-4,279	-22.94%
4.賣出選擇權(Sold Options)	17,219	0.18%	18,534	0.20%	-1,315	-7.10%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	848,464	8.74%	807,582	8.74%	40,882	5.06%
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	391,114	4.03%	340,083	3.68%	51,031	15.01%
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	411,745	4.24%	376,586	4.08%	35,159	9.34%
3.買入選擇權(Bought Options)	10,006	0.10%	50,332	0.54%	-40,326	-80.12%
4.賣出選擇權(Sold Options)	35,599	0.37%	40,581	0.44%	-4,982	-12.28%
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	7,575,482	78.07%	7,285,667	78.88%	289,815	3.98%
(一)店頭市場(OTC)	7,575,482	78.07%	7,285,667	78.88%	289,815	3.98%
1.遠期契約(Outright Forwards)	818,103	8.43%	949,756	10.28%	-131,653	-13.86%
2.換匯(Fx Swaps)	5,275,470	54.37%	5,162,610	55.89%	112,860	2.19%
3.換匯換利(Currency Swaps)	49,212	0.51%	50,381	0.55%	-1,169	-2.32%
4.買入選擇權(Bought Options)	721,360	7.43%	565,181	6.12%	156,179	27.63%
5.賣出選擇權(Sold Options)	711,337	7.33%	557,739	6.04%	153,598	27.54%
(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)	617,179	6.37%	644,710	6.98%	-27,531	-4.27%
(一)店頭市場(OTC)	5,842	0.06%	3,980	0.04%	1,862	46.78%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	611,337	6.31%	640,730	6.94%	-29,393	-4.59%
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	79,889	0.82%	93,514	1.01%	-13,625	-14.57%
(一)店頭市場(OTC)	55,990	0.58%	31,256	0.34%	24,734	79.13%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	23,899	0.24%	62,258	0.67%	-38,359	-61.61%
小 計(一至四)	9,693,378	99.90%	9,232,061	99.95%	461,317	5.00%
五、信用有關契約(Credit Contracts)	9,777	0.10%	4,509	0.05%	5,268	116.83%
1.信用違約交換(Credit Default Swap)	9,777	0.10%	4,509	0.05%	5,268	116.83%
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	9,703,155	100.00%	9,236,570	100.00%	466,585	5.05%

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。