

銀行衍生性金融商品交易量彙總表

100年4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)	300,508	907,662	1,208,170	13.08%
(一)店頭市場(OTC)	300,508	100,080	400,588	4.34%
1. 遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-
2. 換利(IRS)	278,157	85,242	363,399	3.94%
3. 買入選擇權(Bought Options)	11,188	7,467	18,655	0.20%
4. 賣出選擇權(Sold Options)	11,163	7,371	18,534	0.20%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	807,582	807,582	8.74%
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	-	340,083	340,083	3.68%
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	-	376,586	376,586	4.08%
3. 買入選擇權(Bought Options)	-	50,332	50,332	0.54%
4. 賣出選擇權(Sold Options)	-	40,581	40,581	0.44%
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	3,523,683	3,761,984	7,285,667	78.88%
(一)店頭市場(OTC)	3,523,683	3,761,984	7,285,667	78.88%
1. 遠期契約(Outright Forwards)	359,740	590,016	949,756	10.28%
2. 換匯(Fx Swaps)	3,059,486	2,103,124	5,162,610	55.89%
3. 換匯換利(Currency Swaps)	42,667	7,714	50,381	0.55%
4. 買入選擇權(Bought Options)	33,029	532,152	565,181	6.12%
5. 賣出選擇權(Sold Options)	28,761	528,978	557,739	6.04%
(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)	614,634	30,076	644,710	6.98%
(一)店頭市場(OTC)	1,880	2,100	3,980	0.04%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	612,754	27,976	640,730	6.94%
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	15,416	78,098	93,514	1.01%
(一)店頭市場(OTC)	-	31,256	31,256	0.34%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	15,416	46,842	62,258	0.67%
小 計(一至四)	4,454,241	4,777,820	9,232,061	99.95%
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	4,509	4,509	0.05%
1. 信用違約交換(Credit Default Swap)	-	4,509	4,509	0.05%
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	4,454,241	4,782,329	9,236,570	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4月份

單位：新臺幣百萬元

商 品 種 類	100年4月		100年3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)	1,208,170	13.08%	2,009,930	17.56%	-801,760	-39.89%
(一)店頭市場(OTC)	400,588	4.34%	768,648	6.71%	-368,060	-47.88%
1. 遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-	-	0.00%
2. 換利(IRS)	363,399	3.94%	684,822	5.99%	-321,423	-46.94%
3. 買入選擇權(Bought Options)	18,655	0.20%	42,013	0.36%	-23,358	-55.60%
4. 賣出選擇權(Sold Options)	18,534	0.20%	41,813	0.36%	-23,279	-55.67%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	807,582	8.74%	1,241,282	10.85%	-433,700	-34.94%
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	340,083	3.68%	579,690	5.07%	-239,607	-41.33%
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	376,586	4.08%	570,319	4.98%	-193,733	-33.97%
3. 買入選擇權(Bought Options)	50,332	0.54%	35,521	0.31%	14,811	41.70%
4. 賣出選擇權(Sold Options)	40,581	0.44%	55,752	0.49%	-15,171	-27.21%
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	7,285,667	78.88%	8,373,552	73.20%	-1,087,885	-12.99%
(一)店頭市場(OTC)	7,285,667	78.88%	8,373,552	73.20%	-1,087,885	-12.99%
1. 遠期契約(Outright Forwards)	949,756	10.28%	827,652	7.24%	122,104	14.75%
2. 換匯(Fx Swaps)	5,162,610	55.89%	6,158,005	53.83%	-995,395	-16.16%
3. 換匯換利(Currency Swaps)	50,381	0.55%	99,832	0.87%	-49,451	-49.53%
4. 買入選擇權(Bought Options)	565,181	6.12%	654,454	5.72%	-89,273	-13.64%
5. 賣出選擇權(Sold Options)	557,739	6.04%	633,609	5.54%	-75,870	-11.97%
(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)	644,710	6.98%	929,494	8.13%	-284,784	-30.64%
(一)店頭市場(OTC)	3,980	0.04%	152,942	1.34%	-148,962	-97.40%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	640,730	6.94%	776,552	6.79%	-135,822	-17.49%
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	93,514	1.01%	114,388	1.00%	-20,874	-18.25%
(一)店頭市場(OTC)	31,256	0.34%	39,167	0.34%	-7,911	-20.20%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	62,258	0.67%	75,221	0.66%	-12,963	-17.23%
小 計(一至四)	9,232,061	99.95%	11,427,364	99.89%	-2,195,303	-19.21%
五、信用有關契約(Credit Contracts)	4,509	0.05%	12,760	0.11%	-8,251	-64.66%
1. 信用違約交換(Credit Default Swap)	4,509	0.05%	12,760	0.11%	-8,251	-64.66%
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	9,236,570	100.00%	11,440,124	100.00%	-2,203,554	-19.26%

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。