

銀行衍生性金融商品交易量彙總表

100年3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)	558,772	1,451,158	2,009,930	17.56%
(一)店頭市場(OTC)	558,772	209,876	768,648	6.71%
1.遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-
2.換利(IRS)	482,047	202,775	684,822	5.99%
3.買入選擇權(Bought Options)	41,611	402	42,013	0.36%
4.賣出選擇權(Sold Options)	35,114	6,699	41,813	0.36%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	1,241,282	1,241,282	10.85%
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	-	579,690	579,690	5.07%
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	-	570,319	570,319	4.98%
3.買入選擇權(Bought Options)	-	35,521	35,521	0.31%
4.賣出選擇權(Sold Options)	-	55,752	55,752	0.49%
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	4,032,451	4,341,101	8,373,552	73.20%
(一)店頭市場(OTC)	4,032,451	4,341,101	8,373,552	73.20%
1.遠期契約(Outright Forwards)	362,370	465,282	827,652	7.24%
2.換匯(Fx Swaps)	3,538,277	2,619,728	6,158,005	53.83%
3.換匯換利(Currency Swaps)	69,375	30,457	99,832	0.87%
4.買入選擇權(Bought Options)	33,245	621,209	654,454	5.72%
5.賣出選擇權(Sold Options)	29,184	604,425	633,609	5.54%
(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)	905,608	23,886	929,494	8.13%
(一)店頭市場(OTC)	151,852	1,090	152,942	1.34%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	753,756	22,796	776,552	6.79%
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	1,016	113,372	114,388	1.00%
(一)店頭市場(OTC)	-	39,167	39,167	0.34%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	1,016	74,205	75,221	0.66%
小 計(一至四)	5,497,847	5,929,517	11,427,364	99.89%
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	12,760	12,760	0.11%
1.信用違約交換(Credit Default Swap)	-	12,760	12,760	0.11%
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	5,497,847	5,942,277	11,440,124	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3月份

單位：新臺幣百萬元

商品種類	100年3月		100年2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)	2,009,930	17.56%	2,128,946	24.50%	-119,016	-5.59%
(一)店頭市場(OTC)	768,648	6.71%	938,876	10.80%	-170,228	-18.13%
1. 遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-	-	0.00%
2. 換利(IRS)	684,822	5.99%	885,205	10.19%	-200,383	-22.64%
3. 買入選擇權(Bought Options)	42,013	0.36%	22,891	0.26%	19,122	83.54%
4. 賣出選擇權(Sold Options)	41,813	0.36%	30,780	0.35%	11,033	35.84%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	1,241,282	10.85%	1,190,070	13.70%	51,212	4.30%
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	579,690	5.07%	572,468	6.59%	7,222	1.26%
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	570,319	4.98%	579,250	6.67%	-8,931	-1.54%
3. 買入選擇權(Bought Options)	35,521	0.31%	15,631	0.18%	19,890	127.25%
4. 賣出選擇權(Sold Options)	55,752	0.49%	22,721	0.26%	33,031	145.38%
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	8,373,552	73.20%	5,748,710	66.16%	2,624,842	45.66%
(一)店頭市場(OTC)	8,373,552	73.20%	5,748,710	66.16%	2,624,842	45.66%
1. 遠期契約(Outright Forwards)	827,652	7.24%	615,566	7.08%	212,086	34.45%
2. 換匯(Fx Swaps)	6,158,005	53.83%	4,262,844	49.06%	1,895,161	44.46%
3. 換匯換利(Currency Swaps)	99,832	0.87%	45,672	0.53%	54,160	118.58%
4. 買入選擇權(Bought Options)	654,454	5.72%	414,474	4.77%	239,980	57.90%
5. 賣出選擇權(Sold Options)	633,609	5.54%	410,154	4.72%	223,455	54.48%
(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)	929,494	8.13%	681,507	7.84%	247,987	36.39%
(一)店頭市場(OTC)	152,942	1.34%	1,024	0.01%	151,918	14,835.74%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	776,552	6.79%	680,483	7.83%	96,069	14.12%
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	114,388	1.00%	124,858	1.44%	-10,470	-8.39%
(一)店頭市場(OTC)	39,167	0.34%	34,022	0.39%	5,145	15.12%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	75,221	0.66%	90,836	1.05%	-15,615	-17.19%
小計(一至四)	11,427,364	99.89%	8,684,021	99.94%	2,743,343	31.59%
五、信用有關契約(Credit Contracts)	12,760	0.11%	5,621	0.06%	7,139	127.01%
1. 信用違約交換(Credit Default Swap)	12,760	0.11%	5,621	0.06%	7,139	127.01%
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	11,440,124	100.00%	8,689,642	100.00%	2,750,482	31.65%

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。