

銀行衍生性金融商品交易量彙總表

100年6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)	467,014	1,579,384	2,046,398	18.45%
(一)店頭市場(OTC)	467,014	422,448	889,462	8.02%
1. 遠期利率協議(FRA)	-	15,568	15,568	0.14%
2. 換利(IRS)	443,848	388,779	832,627	7.51%
3. 買入選擇權(Bought Options)	11,197	158	11,355	0.10%
4. 賣出選擇權(Sold Options)	11,969	17,943	29,912	0.27%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	1,156,936	1,156,936	10.43%
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	-	543,715	543,715	4.90%
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	-	556,006	556,006	5.02%
3. 買入選擇權(Bought Options)	-	24,730	24,730	0.22%
4. 賣出選擇權(Sold Options)	-	32,485	32,485	0.29%
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	3,770,119	4,666,959	8,437,078	76.08%
(一)店頭市場(OTC)	3,770,119	4,666,959	8,437,078	76.08%
1. 遠期契約(Outright Forwards)	338,161	479,424	817,585	7.37%
2. 換匯(Fx Swaps)	3,319,034	2,824,538	6,143,572	55.40%
3. 換匯換利(Currency Swaps)	59,075	17,794	76,869	0.69%
4. 買入選擇權(Bought Options)	30,598	668,965	699,563	6.31%
5. 賣出選擇權(Sold Options)	23,251	676,238	699,489	6.31%
(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)	449,010	26,304	475,314	4.29%
(一)店頭市場(OTC)	7,152	2,027	9,179	0.08%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	441,858	24,277	466,135	4.21%
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	1,251	114,047	115,298	1.04%
(一)店頭市場(OTC)	-	90,555	90,555	0.82%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	1,251	23,492	24,743	0.22%
小 計(一至四)	4,687,394	6,386,694	11,074,088	99.86%
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	15,628	15,628	0.14%
1. 信用違約交換(Credit Default Swap)	-	15,628	15,628	0.14%
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	4,687,394	6,402,322	11,089,716	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6月份

單位：新臺幣百萬元

商 品 種 類	100年6月		100年5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)	2,046,398	18.45%	1,420,828	14.64%	625,570	44.03%
(一)店頭市場(OTC)	889,462	8.02%	572,364	5.90%	317,098	55.40%
1. 遠期利率協議(FRA)	15,568	0.14%	-	-	15,568	0.00%
2. 換利(IRS)	832,627	7.51%	540,769	5.57%	291,858	53.97%
3. 買入選擇權(Bought Options)	11,355	0.10%	14,376	0.15%	-3,021	-21.01%
4. 賣出選擇權(Sold Options)	29,912	0.27%	17,219	0.18%	12,693	73.72%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	1,156,936	10.43%	848,464	8.74%	308,472	36.36%
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	543,715	4.90%	391,114	4.03%	152,601	39.02%
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	556,006	5.02%	411,745	4.24%	144,261	35.04%
3. 買入選擇權(Bought Options)	24,730	0.22%	10,006	0.10%	14,724	147.15%
4. 賣出選擇權(Sold Options)	32,485	0.29%	35,599	0.37%	-3,114	-8.75%
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	8,437,078	76.08%	7,575,482	78.07%	861,596	11.37%
(一)店頭市場(OTC)	8,437,078	76.08%	7,575,482	78.07%	861,596	11.37%
1. 遠期契約(Outright Forwards)	817,585	7.37%	818,103	8.43%	-518	-0.06%
2. 換匯(Fx Swaps)	6,143,572	55.40%	5,275,470	54.37%	868,102	16.46%
3. 換匯換利(Currency Swaps)	76,869	0.69%	49,212	0.51%	27,657	56.20%
4. 買入選擇權(Bought Options)	699,563	6.31%	721,360	7.43%	-21,797	-3.02%
5. 賣出選擇權(Sold Options)	699,489	6.31%	711,337	7.33%	-11,848	-1.67%
(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)	475,314	4.29%	617,179	6.37%	-141,865	-22.99%
(一)店頭市場(OTC)	9,179	0.08%	5,842	0.06%	3,337	57.12%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	466,135	4.21%	611,337	6.31%	-145,202	-23.75%
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	115,298	1.04%	79,889	0.82%	35,409	44.32%
(一)店頭市場(OTC)	90,555	0.82%	55,990	0.58%	34,565	61.73%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	24,743	0.22%	23,899	0.24%	844	3.53%
小 計(一至四)	11,074,088	99.86%	9,693,378	99.90%	1,380,710	14.24%
五、信用有關契約(Credit Contracts)	15,628	0.14%	9,777	0.10%	5,851	59.84%
1. 信用違約交換(Credit Default Swap)	15,628	0.14%	9,777	0.10%	5,851	59.84%
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	11,089,716	100.00%	9,703,155	100.00%	1,386,561	14.29%

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。