

附表1 銀行衍生性金融商品交易量彙總表

101年2月

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)	482,566	554,990	1,037,556	10.49%
(一)店頭市場(OTC)	482,566	116,470	599,036	6.06%
1.遠期利率協議(FRA)	-	11,748	11,748	0.12%
2.換利(IRS)	465,680	96,711	562,391	5.69%
3.買入選擇權(Bought Options)	8,732	2,942	11,674	0.12%
4.賣出選擇權(Sold Options)	8,154	5,069	13,223	0.13%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	438,520	438,520	4.43%
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	-	210,989	210,989	2.13%
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	-	227,531	227,531	2.30%
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)	4,149,947	4,337,849	8,487,796	85.84%
(一)店頭市場(OTC)	4,149,947	4,337,849	8,487,796	85.84%
1.遠期契約(Outright Forwards)	335,926	760,554	1,096,480	11.09%
2.換匯(Fx Swaps)	3,661,171	2,368,662	6,029,833	60.98%
3.換匯換利(Currency Swaps)	88,495	309	88,804	0.90%
4.買入選擇權(Bought Options)	34,124	598,509	632,633	6.40%
5.賣出選擇權(Sold Options)	30,231	609,815	640,046	6.47%
(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)	260,032	12,495	272,527	2.76%
(一)店頭市場(OTC)	745	1,591	2,336	0.03%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	259,287	10,904	270,191	2.73%
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	3,088	76,054	79,142	0.80%
(一)店頭市場(OTC)	-	68,799	68,799	0.70%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	3,088	7,255	10,343	0.10%
小 計(一至四)	4,895,633	4,981,388	9,877,021	99.89%
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	11,395	11,395	0.11%
1.信用違約交換(Credit Default Swap)	-	11,395	11,395	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	4,895,633	4,992,783	9,888,416	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。

附表2 銀行衍生性金融商品交易量比較表

101年2月

單位：新臺幣百萬元

商 品 種 類	101年2月		101年1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)	1,037,556	10.49%	886,124	10.42%	151,432	17.09%
(一)店頭市場(OTC)	599,036	6.06%	532,445	6.26%	66,591	12.51%
1.遠期利率協議(FRA)	11,748	0.12%	-	-	11,748	0.00%
2.換利(IRS)	562,391	5.69%	501,391	5.89%	61,000	12.17%
3.買入選擇權(Bought Options)	11,674	0.12%	7,267	0.09%	4,407	60.64%
4.賣出選擇權(Sold Options)	13,223	0.13%	23,787	0.28%	-10,564	-44.41%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	438,520	4.43%	353,679	4.16%	84,841	23.99%
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	210,989	2.13%	160,594	1.89%	50,395	31.38%
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	227,531	2.30%	193,085	2.27%	34,446	17.84%
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)	8,487,796	85.84%	7,385,295	86.80%	1,102,501	14.93%
(一)店頭市場(OTC)	8,487,796	85.84%	7,385,295	86.80%	1,102,501	14.93%
1.遠期契約(Outright Forwards)	1,096,480	11.09%	1,002,376	11.78%	94,104	9.39%
2.換匯(Fx Swaps)	6,029,833	60.98%	5,060,240	59.48%	969,593	19.16%
3.換匯換利(Currency Swaps)	88,804	0.90%	60,371	0.71%	28,433	47.10%
4.買入選擇權(Bought Options)	632,633	6.40%	628,305	7.38%	4,328	0.69%
5.賣出選擇權(Sold Options)	640,046	6.47%	634,003	7.45%	6,043	0.95%
(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)	272,527	2.76%	179,677	2.11%	92,850	51.68%
(一)店頭市場(OTC)	2,336	0.03%	1,716	0.02%	620	36.13%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	270,191	2.73%	177,961	2.09%	92,230	51.83%
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	79,142	0.80%	50,623	0.60%	28,519	56.34%
(一)店頭市場(OTC)	68,799	0.70%	40,106	0.47%	28,693	71.54%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	10,343	0.10%	10,517	0.13%	-174	-1.65%
小 計(一至四)	9,877,021	99.89%	8,501,719	99.93%	1,375,302	16.18%
五、信用有關契約(Credit Contracts)	11,395	0.11%	6,299	0.07%	5,096	80.90%
1.信用違約交換(Credit Default Swap)	11,395	0.11%	6,299	0.07%	5,096	80.90%
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	9,888,416	100.00%	8,508,018	100.00%	1,380,398	16.22%

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。

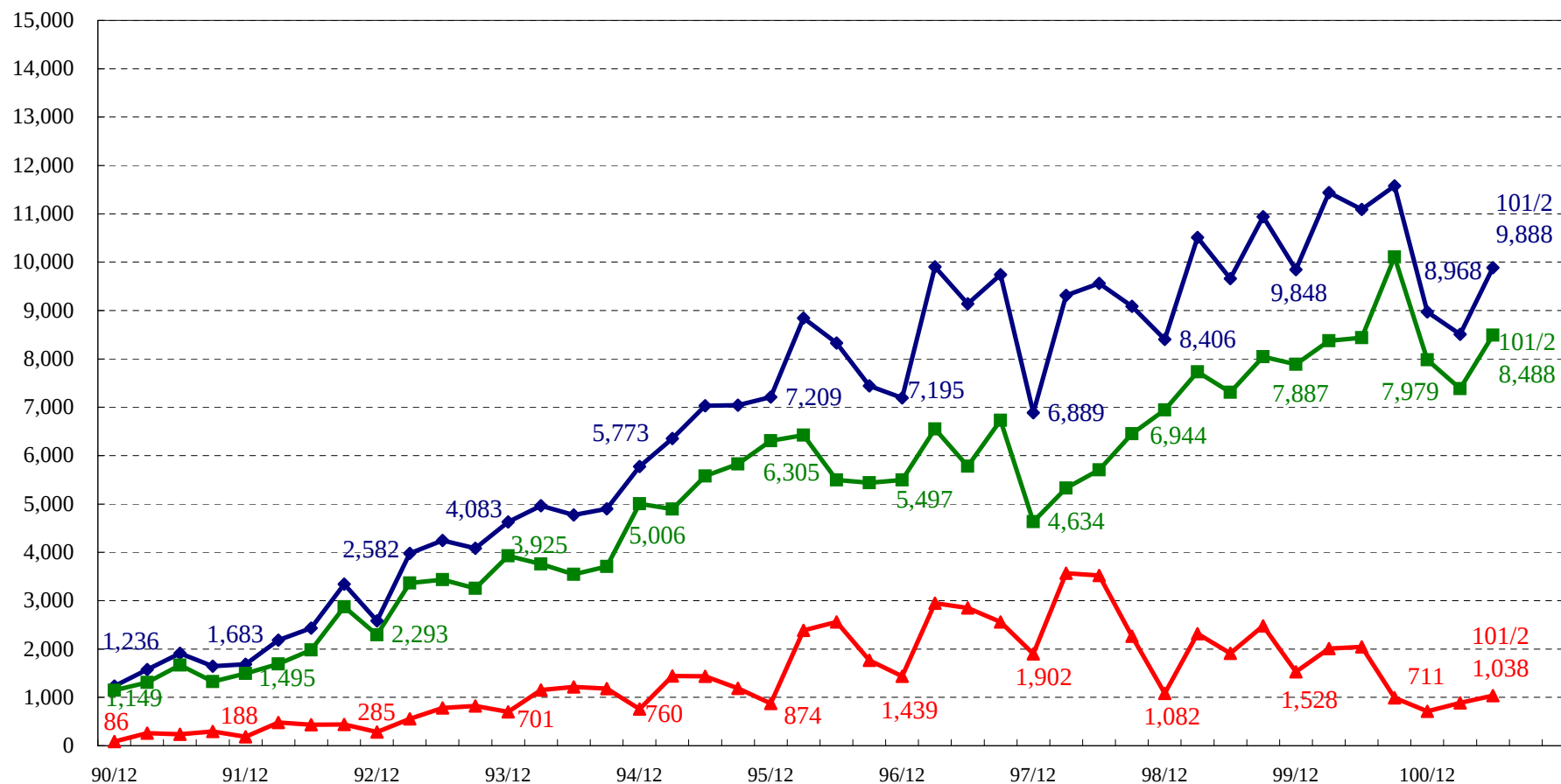
3. 「匯率有關—遠期契約」中「涉及新臺幣交易」金額包括新臺幣對外幣無本金交割遠期外匯交易；「純外幣交易」金額包括外幣保證金交易以遠期契約承作者。

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。

附圖1 101年2月銀行辦理衍生性金融商品交易量統計

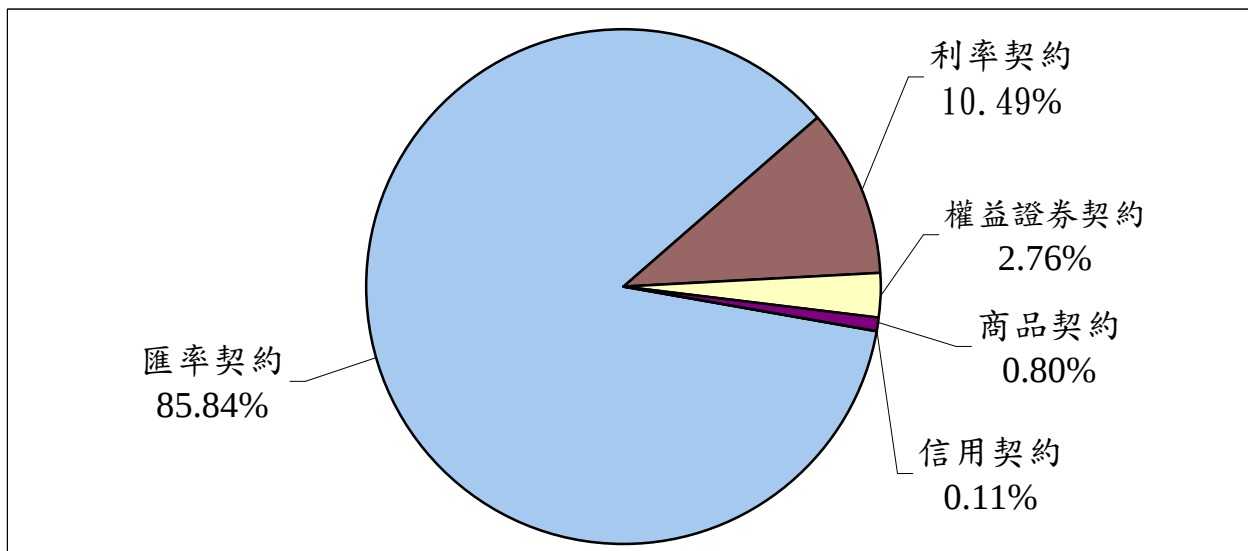
新臺幣十億元

◆ 總交易量 ■ 匯率有關契約 ▲ 利率有關契約

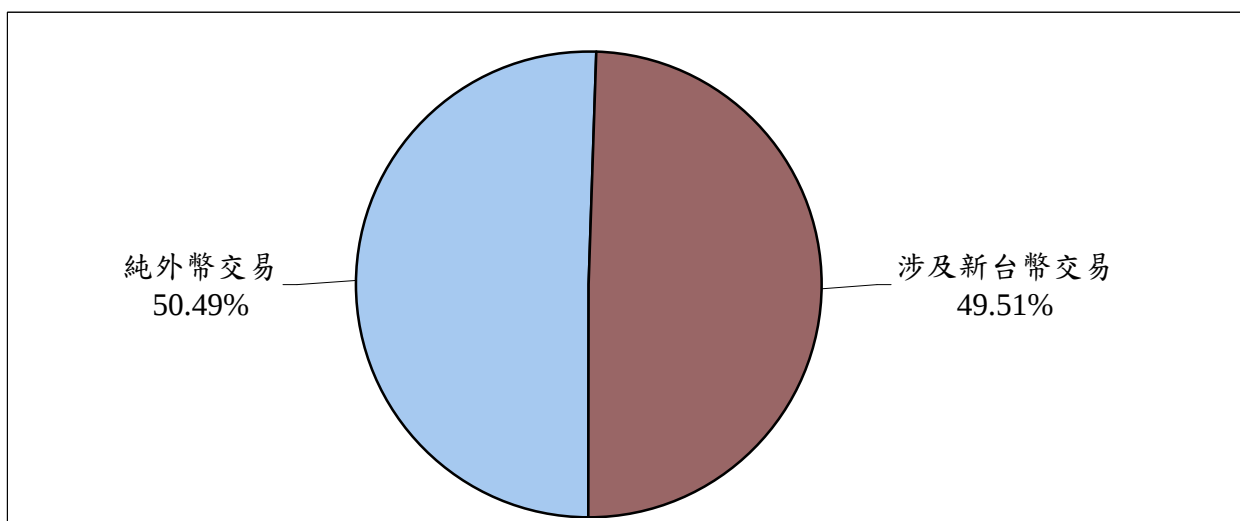


附圖2 101年2月銀行衍生性金融商品交易量內容分析

商品種類別



幣別



銀行類別

