

附表1 銀行衍生性金融商品交易量彙總表

102年7月

單位：新臺幣百萬元；%

商 品 種 類	本國銀行及外國銀行在台分行 ¹			
	涉及新臺幣交易	純外幣交易	合 計	比重
一、利率有關契約(Interest Rate Contracts)	154,721	396,136	550,857	4.27
(一)店頭市場(OTC)	154,721	60,760	215,481	1.67
1.遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-
2.換利(IRS)	148,074	53,921	201,995	1.56
3.買入選擇權(Bought Options)	1,867	435	2,302	0.02
4.賣出選擇權(Sold Options)	4,780	6,404	11,184	0.09
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	335,376	335,376	2.60
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	-	163,612	163,612	1.27
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	-	171,764	171,764	1.33
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)	4,420,670	7,462,485	11,883,155	92.19
(一)店頭市場(OTC)	4,420,670	7,462,485	11,883,155	92.19
1.遠期契約(Outright Forwards) ²	317,676	607,667	925,343	7.18
2.換匯(Fx Swaps)	3,946,405	4,215,658	8,162,063	63.32
3.換匯換利(Currency Swaps)	112,095	8,404	120,499	0.93
4.買入選擇權(Bought Options)	22,775	1,317,210	1,339,985	10.40
5.賣出選擇權(Sold Options)	21,719	1,313,546	1,335,265	10.36
(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)	408,306	16,006	424,312	3.29
(一)店頭市場(OTC)	426	5,138	5,564	0.04
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	407,880	10,868	418,748	3.25
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	1,543	27,764	29,307	0.23
(一)店頭市場(OTC)	-	16,469	16,469	0.13
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	1,543	11,295	12,838	0.10
小 計(一至四)	4,985,240	7,902,391	12,887,631	99.98
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	2,873	2,873	0.02
1.信用違約交換(Credit Default Swap)	-	2,873	2,873	0.02
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	4,985,240	7,905,264	12,890,504	100.00

註：1. 包括國內總分支機構及國際金融業務分行資料，不含海外分行及子行；本表已剔除銀行間交易重複計算部分。

2. 「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。

附表2 銀行衍生性金融商品交易量比較表

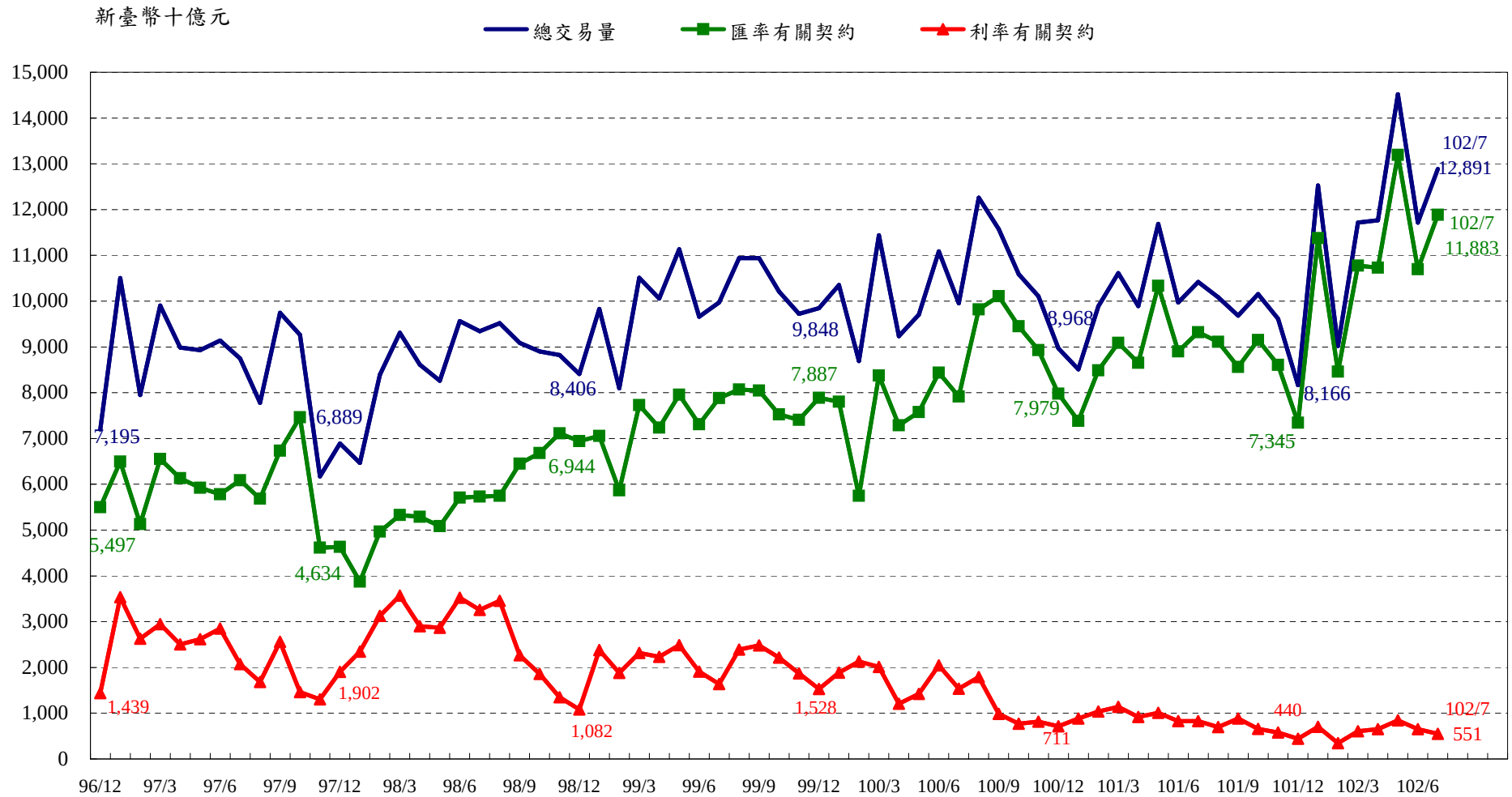
單位：新臺幣百萬元；%

商 品 種 類	102年7月		102年6月		比較增減	
	合計 ¹	比重	合計	比重	差 額	變動率
一、利率有關契約 (Interest Rate Contracts)	550,857	4.27	649,559	5.54	-98,702	-15.20
(一)店頭市場(OTC)	215,481	1.67	287,357	2.45	-71,876	-25.01
1.遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-	-	-
2.換利(IRS)	201,995	1.56	272,064	2.32	-70,069	-25.75
3.買入選擇權(Bought Options)	2,302	0.02	5,065	0.04	-2,763	-54.55
4.賣出選擇權(Sold Options)	11,184	0.09	10,228	0.09	956	9.35
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	335,376	2.60	362,202	3.09	-26,826	-7.41
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	163,612	1.27	191,645	1.64	-28,033	-14.63
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	171,764	1.33	170,557	1.45	1,207	0.71
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)	11,883,155	92.19	10,698,044	91.32	1,185,111	11.08
(一)店頭市場(OTC)	11,883,155	92.19	10,698,044	91.32	1,185,111	11.08
1.遠期契約(Outright Forwards) ²	925,343	7.18	1,059,770	9.05	-134,428	-12.68
2.換匯(Fx Swaps)	8,162,063	63.32	7,253,708	61.92	908,355	12.52
3.換匯換利(Currency Swaps)	120,499	0.93	68,555	0.58	51,944	75.77
4.買入選擇權(Bought Options)	1,339,985	10.40	1,143,712	9.76	196,273	17.16
5.賣出選擇權(Sold Options)	1,335,265	10.36	1,172,299	10.01	162,966	13.90
(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)	424,312	3.29	332,346	2.84	91,966	27.67
(一)店頭市場(OTC)	5,564	0.04	1,927	0.02	3,637	188.74
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	418,748	3.25	330,419	2.82	88,329	26.73
四、商品有關契約 (Commodity Contracts)	29,307	0.23	24,890	0.21	4,417	17.75
(一)店頭市場(OTC)	16,469	0.13	14,711	0.12	1,758	11.95
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	12,838	0.10	10,179	0.09	2,659	26.12
小 計(一至四)	12,887,631	99.98	11,704,839	99.91	1,182,792	10.11
五、信用有關契約 (Credit Contracts)	2,873	0.02	10,694	0.09	-7,821	-73.13
1.信用違約交換(Credit Default Swap)	2,873	0.02	10,694	0.09	-7,821	-73.13
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	12,890,504	100.00	11,715,533	100.00	1,174,971	10.03

註：1. 包括國內總分支機構及國際金融業務分行資料，不含海外分行及子行；本表已剔除銀行間交易重複計算部分。

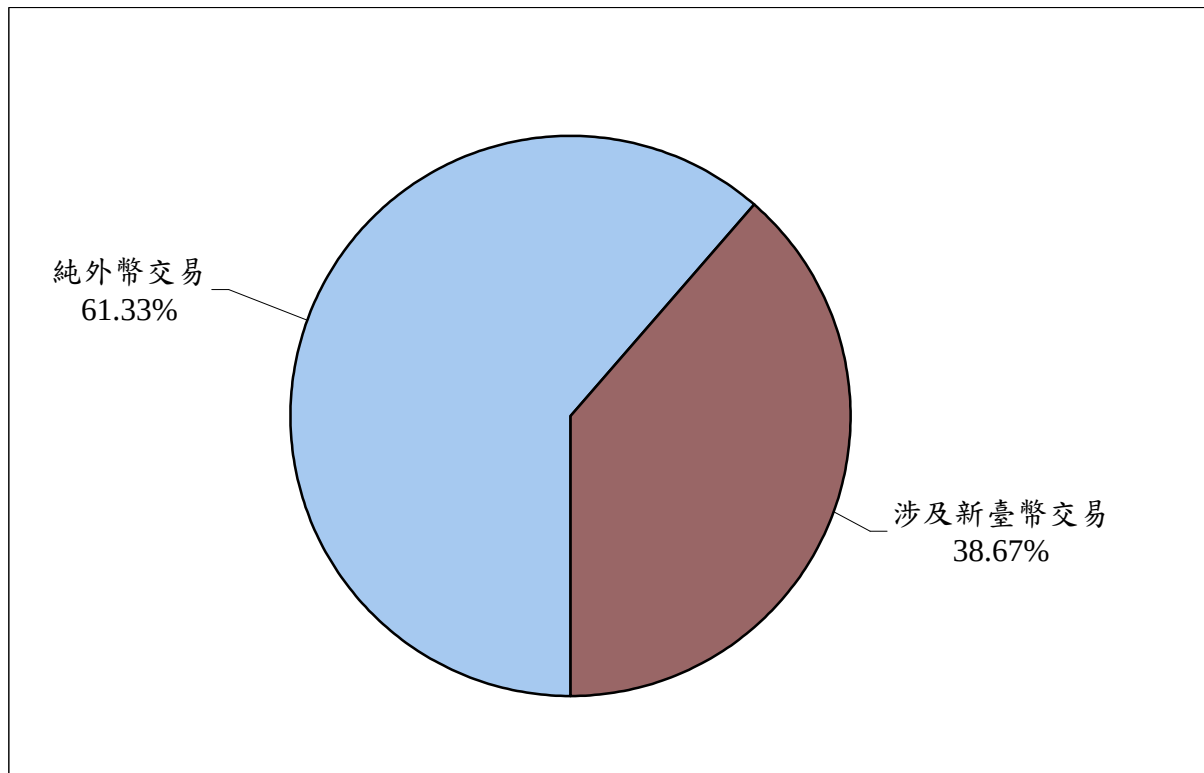
2. 「匯率有關—遠期契約」中「涉及新臺幣交易」金額包括新臺幣對外幣無本金交割遠期外匯交易；「純外幣交易」金額包括外幣保證金交易以遠期契約承作者。

附圖1 102年7月銀行辦理衍生性金融商品交易量統計



附圖2 102年7月銀行衍生性金融商品交易量內容分析

幣別



銀行類別

