

附表1 銀行衍生性金融商品交易量彙總表

103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)	91,275	609,691	700,966	5.44
(一)店頭市場(OTC)	91,275	29,992	121,267	0.94
1.遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-
2.換利(IRS)	82,665	29,030	111,695	0.87
3.買入選擇權(Bought Options)	3,123	-	3,123	0.02
4.賣出選擇權(Sold Options)	5,487	962	6,449	0.05
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	579,699	579,699	4.50
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	-	276,681	276,681	2.15
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	-	278,235	278,235	2.16
3.買入選擇權(Bought Options)	-	7,510	7,510	0.06
4.賣出選擇權(Sold Options)	-	17,273	17,273	0.13
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	4,965,786	6,501,870	11,467,656	90.01
(一)店頭市場(OTC)	4,965,786	6,501,870	11,467,656	90.01
1.遠期契約(Outright Forwards) ²	252,987	657,294	910,281	7.06
2.換匯(Fx Swaps)	4,580,519	3,650,607	8,231,126	63.83
3.換匯換利(Currency Swaps)	76,452	3,951	80,403	0.62
4.買入選擇權(Bought Options)	29,350	1,071,961	1,101,311	9.08
5.賣出選擇權(Sold Options)	26,478	1,118,057	1,144,535	9.42
(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)	533,189	8,301	541,490	4.20
(一)店頭市場(OTC)	2,335	340	2,675	0.02
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	530,854	7,961	538,815	4.18
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	666	41,641	42,307	0.33
(一)店頭市場(OTC)	-	11,364	11,364	0.09
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	666	30,277	30,943	0.24
小 計(一至四)	5,590,916	7,161,503	12,752,419	99.98
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	3,012	3,012	0.02
1.信用違約交換(Credit Default Swap)	-	3,012	3,012	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	5,590,916	7,164,515	12,755,431	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

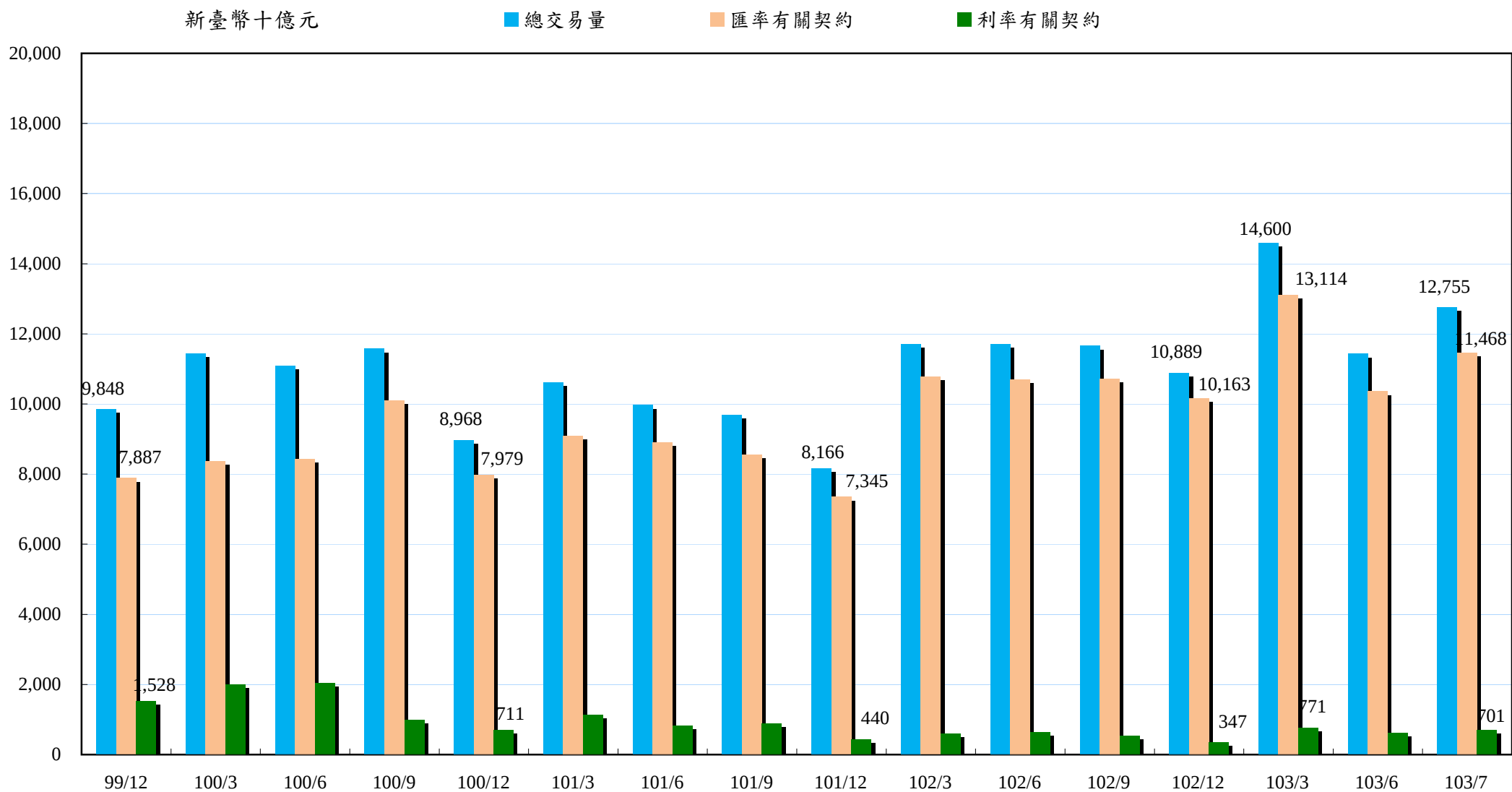
單位：新臺幣百萬元；%

商 品 種 類	103年7月		103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)	700,966	5.44	620,047	5.43	80,919	13.05
(一)店頭市場(OTC)	121,267	0.94	178,924	1.57	-57,657	-32.22
1. 遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-	-	-
2. 換利(IRS)	111,695	0.87	171,445	1.50	-59,750	-34.85
3. 買入選擇權(Bought Options)	3,123	0.02	804	0.01	2,319	288.43
4. 賣出選擇權(Sold Options)	6,449	0.05	6,675	0.06	-226	-3.39
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	579,699	4.50	441,123	3.86	138,576	31.41
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	276,681	2.15	198,437	1.74	78,244	39.43
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	278,235	2.16	215,763	1.89	62,472	28.95
3. 買入選擇權(Bought Options)	7,510	0.06	11,966	0.10	-4,456	-37.24
4. 賣出選擇權(Sold Options)	17,273	0.13	14,957	0.13	2,316	15.48
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	11,467,656	90.01	10,364,627	90.66	1,103,029	10.64
(一)店頭市場(OTC)	11,467,656	90.01	10,364,627	90.66	1,103,029	10.64
1. 遠期契約(Outright Forwards) ²	910,281	7.06	830,295	7.26	79,986	9.63
2. 換匯(Fx Swaps)	8,231,126	63.83	7,910,339	69.19	320,787	4.06
3. 換匯換利(Currency Swaps)	80,403	0.62	111,363	0.98	-30,960	-27.80
4. 買入選擇權(Bought Options)	1,101,311	9.08	762,310	6.67	339,001	44.47
5. 賣出選擇權(Sold Options)	1,144,535	9.42	750,320	6.56	394,215	52.54
(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)	541,490	4.20	390,181	3.41	151,309	38.78
(一)店頭市場(OTC)	2,675	0.02	18,369	0.16	-15,694	-85.44
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	538,815	4.18	371,812	3.25	167,003	44.92
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	42,307	0.33	55,984	0.49	-13,677	-24.43
(一)店頭市場(OTC)	11,364	0.09	8,168	0.07	3,196	39.13
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	30,943	0.24	47,816	0.42	-16,873	-35.29
小 計(一至四)	12,752,419	99.98	11,430,839	99.99	1,321,580	11.56
五、信用有關契約(Credit Contracts)	3,012	0.02	1,529	0.01	1,483	96.99
1. 信用違約交換(Credit Default Swap)	3,012	0.02	1,529	0.01	1,483	96.99
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	12,755,431	100.00	11,432,368	100.00	1,323,063	11.57

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。

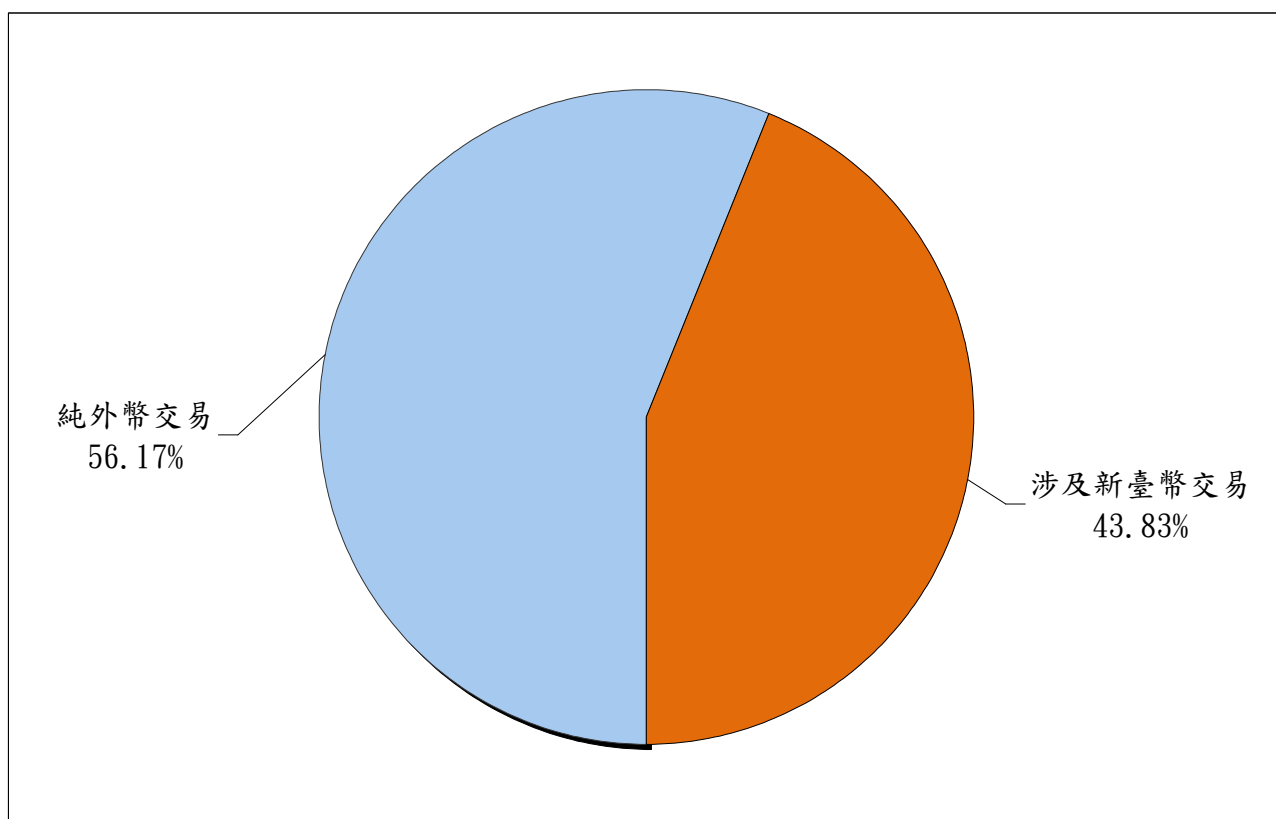
2. 「匯率有關—遠期契約」中「涉及新臺幣交易」金額包括新臺幣對外幣無本金交割遠期外匯交易；「純外幣交易」金額包括外幣保證金交易以遠期契約承作者。

附圖1 銀行辦理衍生性金融商品交易量統計



附圖2 103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

