

附表1 銀行衍生性金融商品交易量彙總表

101年5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	比重
一、利率有關契約(Interest Rate Contracts)	320,715	686,552	1,007,267	8.62
(一)店頭市場(OTC)	320,715	122,405	443,120	3.79
1. 遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-
2. 換利(IRS)	309,795	113,322	423,117	3.62
3. 買入選擇權(Bought Options)	4,338	-	4,338	0.04
4. 賣出選擇權(Sold Options)	6,582	9,083	15,665	0.13
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	564,147	564,147	4.83
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	-	288,614	288,614	2.47
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	-	275,533	275,533	2.36
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)	4,919,362	5,415,806	10,335,168	88.43
(一)店頭市場(OTC)	4,919,362	5,415,806	10,335,168	88.43
1. 遠期契約(Outright Forwards)	454,048	876,543	1,330,591	11.38
2. 換匯(Fx Swaps)	4,170,006	2,761,875	6,931,881	59.31
3. 換匯換利(Currency Swaps)	64,423	981	65,404	0.56
4. 買入選擇權(Bought Options)	105,528	885,034	990,562	8.48
5. 賣出選擇權(Sold Options)	125,357	891,373	1,016,730	8.70
(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)	267,625	17,256	284,881	2.43
(一)店頭市場(OTC)	733	2,489	3,222	0.02
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	266,892	14,767	281,659	2.41
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	1,712	44,428	46,140	0.40
(一)店頭市場(OTC)	-	39,404	39,404	0.34
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	1,712	5,024	6,736	0.06
小 計(一至四)	5,509,414	6,164,042	11,673,456	99.88
五、信用有關契約(Credit Contracts)	3,000	10,403	13,403	0.12
1. 信用違約交換(Credit Default Swap)	3,000	10,403	13,403	0.12
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	5,512,414	6,174,445	11,686,859	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5月

單位：新臺幣百萬元，%

商 品 種 類	101年5月		101年4月		比較增減	
	合 計	比重	合 計	比重	合 計	變動率
一、利率有關契約(Interest Rate Contracts)	1,007,267	8.62	917,573	9.28	89,694	9.78
(一)店頭市場(OTC)	443,120	3.79	517,995	5.24	-74,875	-14.45
1.遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-	-	-
2.換利(IRS)	423,117	3.62	485,198	4.91	-62,081	-12.79
3.買入選擇權(Bought Options)	4,338	0.04	9,751	0.10	-5,413	-55.51
4.賣出選擇權(Sold Options)	15,665	0.13	23,046	0.23	-7,381	-32.03
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	564,147	4.83	399,578	4.04	164,569	41.19
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	288,614	2.47	196,161	1.98	92,453	47.13
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	275,533	2.36	203,417	2.06	72,116	35.45
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)	10,335,168	88.43	8,654,338	87.48	1,680,830	19.42
(一)店頭市場(OTC)	10,335,168	88.43	8,654,338	87.48	1,680,830	19.42
1.遠期契約(Outright Forwards)	1,330,591	11.38	1,201,586	12.15	129,005	10.74
2.換匯(Fx Swaps)	6,931,881	59.31	5,791,853	58.55	1,140,028	19.68
3.換匯換利(Currency Swaps)	65,404	0.56	107,417	1.08	-42,013	-39.11
4.買入選擇權(Bought Options)	990,562	8.48	779,112	7.87	211,450	27.14
5.賣出選擇權(Sold Options)	1,016,730	8.70	774,370	7.83	242,360	31.30
(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)	284,881	2.43	276,216	2.79	8,665	3.14
(一)店頭市場(OTC)	3,222	0.02	2,361	0.02	861	36.47
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	281,659	2.41	273,855	2.77	7,804	2.85
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	46,140	0.40	37,399	0.38	8,741	23.37
(一)店頭市場(OTC)	39,404	0.34	31,479	0.32	7,925	25.18
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	6,736	0.06	5,920	0.06	816	13.78
小 計(一至四)	11,673,456	99.88	9,885,526	99.93	1,787,930	18.09
五、信用有關契約(Credit Contracts)	13,403	0.12	7,308	0.07	6,095	83.40
1.信用違約交換(Credit Default Swap)	13,403	0.12	7,308	0.07	6,095	83.40
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	11,686,859	100.00	9,892,834	100.00	1,794,025	18.13

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。

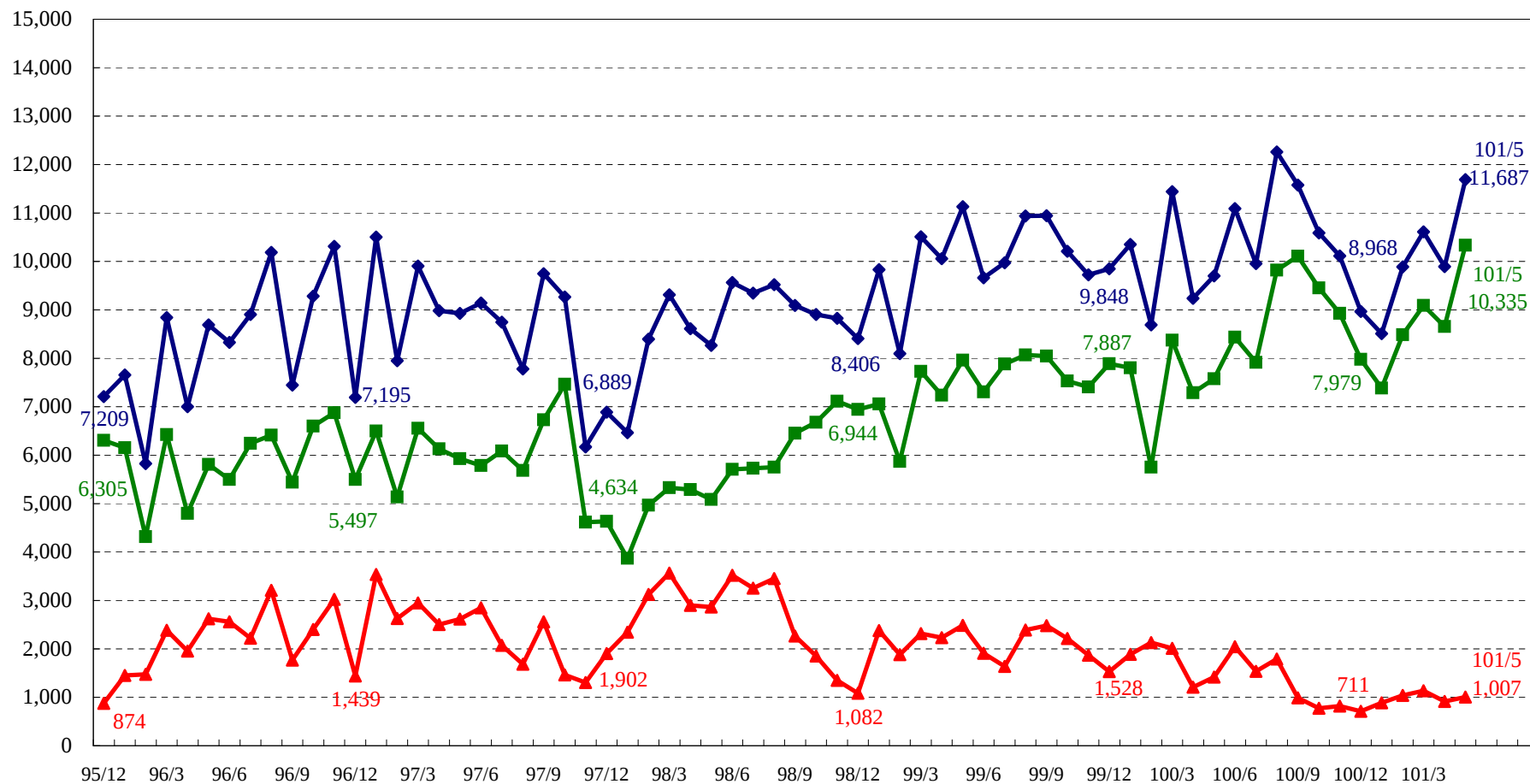
3.「匯率有關—遠期契約」中「涉及新臺幣交易」金額包括新臺幣對外幣無本金交割遠期外匯交易；「純外幣交易」金額包括外幣保證金交易以遠期契約承作者。

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5月銀行辦理衍生性金融商品交易量統計

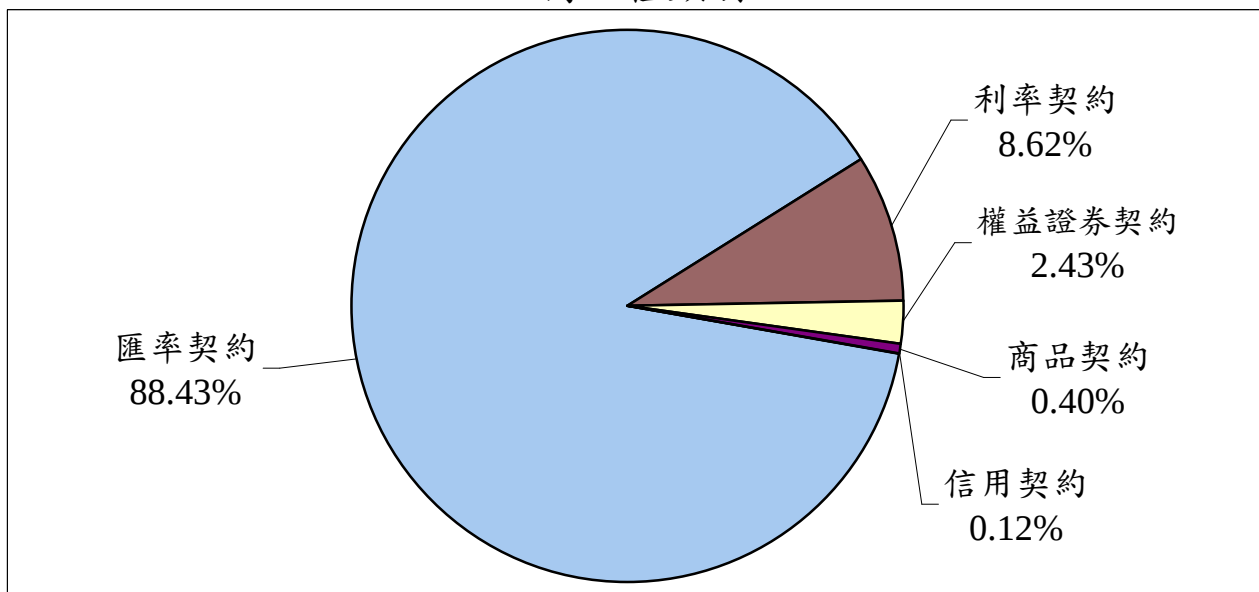
新臺幣十億元

總交易量 匯率有關契約 利率有關契約

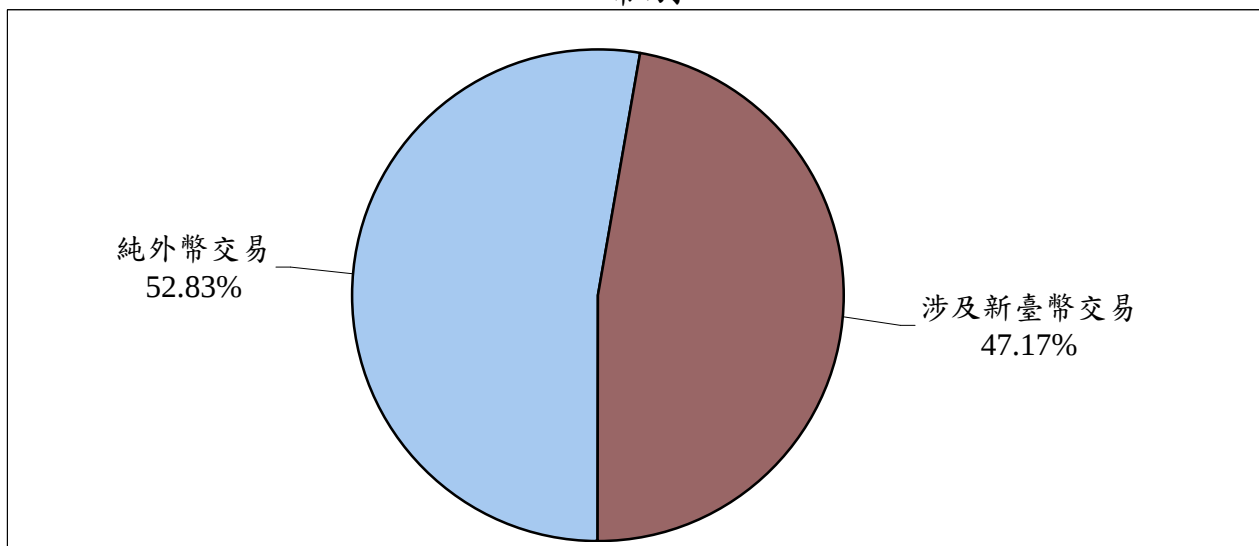


附圖2 101年5月銀行衍生性金融商品交易量內容分析

商品種類別



幣別



銀行類別

