

附表1 銀行衍生性金融商品交易量彙總表

103年10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)	63,401	577,196	640,597	4.58
(一)店頭市場(OTC)	63,109	77,675	140,784	1.00
1.遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-
2.換利(IRS)	58,389	65,252	123,641	0.88
3.買入選擇權(Bought Options)	1,105	-	1,105	0.01
4.賣出選擇權(Sold Options)	3,615	12,423	16,038	0.11
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	292	499,521	499,813	3.58
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	-	218,736	218,736	1.56
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	-	219,416	219,416	1.57
3.買入選擇權(Bought Options)	146	36,985	37,131	0.27
4.賣出選擇權(Sold Options)	146	24,384	24,530	0.18
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	5,238,196	7,598,261	12,836,457	91.78
(一)店頭市場(OTC)	5,238,196	7,598,261	12,836,457	91.78
1.遠期契約(Outright Forwards) ²	245,349	960,081	1,205,430	8.62
2.換匯(Fx Swaps)	4,836,181	4,340,088	9,176,269	65.61
3.換匯換利(Currency Swaps)	104,806	3,044	107,850	0.77
4.買入選擇權(Bought Options)	26,372	1,175,835	1,202,207	8.60
5.賣出選擇權(Sold Options)	25,488	1,119,213	1,144,701	8.18
(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)	462,501	28,967	491,468	3.51
(一)店頭市場(OTC)	7,825	296	8,121	0.06
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	454,676	28,671	483,347	3.45
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	709	10,236	10,945	0.08
(一)店頭市場(OTC)	-	7,031	7,031	0.05
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	709	3,205	3,914	0.03
小 計(一至四)	5,764,807	8,214,660	13,979,467	99.95
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	6,571	6,571	0.05
1.信用違約交換(Credit Default Swap)	-	6,571	6,571	0.05
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	5,764,807	8,221,231	13,986,038	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

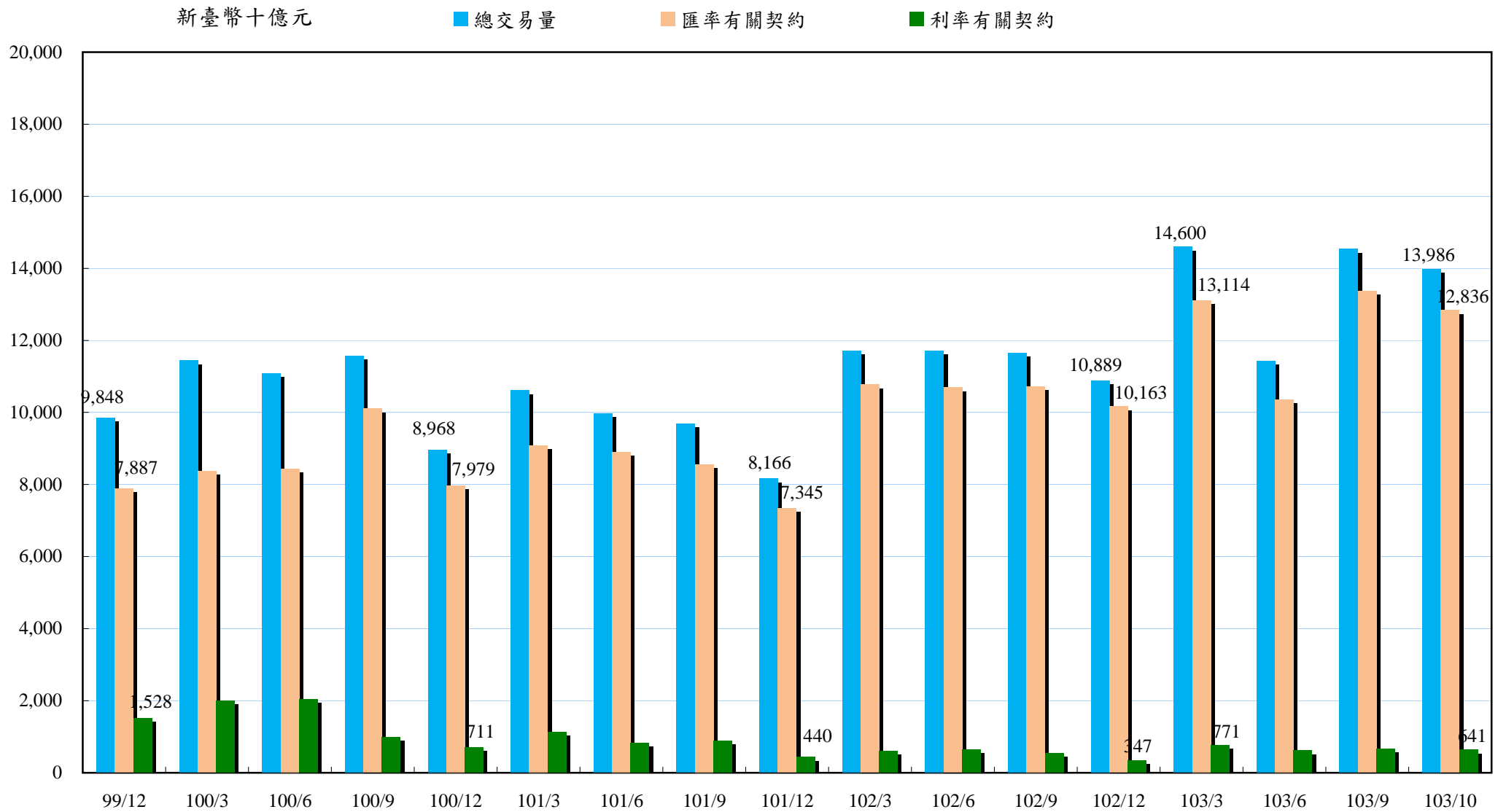
單位：新臺幣百萬元；%

商品種類	103年10月		103年9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)	640,597	4.58	672,338	4.63	-31,741	-4.72
(一)店頭市場(OTC)	140,784	1.00	163,894	1.13	-23,110	-14.10
1. 遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-	-	-
2. 換利(IRS)	123,641	0.88	157,149	1.08	-33,508	-21.32
3. 買入選擇權(Bought Options)	1,105	0.01	1,091	0.01	14	1.28
4. 賣出選擇權(Sold Options)	16,038	0.11	5,654	0.04	10,384	183.66
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	499,813	3.58	508,444	3.50	-8,631	-1.70
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	218,736	1.56	216,969	1.49	1,767	0.81
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	219,416	1.57	224,114	1.54	-4,698	-2.10
3. 買入選擇權(Bought Options)	37,131	0.27	24,349	0.17	12,782	52.49
4. 賣出選擇權(Sold Options)	24,530	0.18	43,012	0.30	-18,482	-42.97
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	12,836,457	91.78	13,367,321	91.96	-530,864	-3.97
(一)店頭市場(OTC)	12,836,457	91.78	13,367,321	91.96	-530,864	-3.97
1. 遠期契約(Outright Forwards) ²	1,205,430	8.62	1,186,636	8.16	18,794	1.58
2. 換匯(Fx Swaps)	9,176,269	65.61	8,915,593	61.34	260,676	2.92
3. 換匯換利(Currency Swaps)	107,850	0.77	102,165	0.70	5,685	5.56
4. 買入選擇權(Bought Options)	1,202,207	8.60	1,598,521	11.00	-396,314	-24.79
5. 賣出選擇權(Sold Options)	1,144,701	8.18	1,564,406	10.76	-419,705	-26.83
(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)	491,468	3.51	468,145	3.22	23,323	4.98
(一)店頭市場(OTC)	8,121	0.06	5,647	0.04	2,474	43.81
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	483,347	3.45	462,498	3.18	20,849	4.51
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	10,945	0.08	26,349	0.18	-15,404	-58.46
(一)店頭市場(OTC)	7,031	0.05	14,156	0.10	-7,125	-50.33
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	3,914	0.03	12,193	0.08	-8,279	-67.90
小計(一至四)	13,979,467	99.95	14,534,153	99.99	-554,686	-3.82
五、信用有關契約(Credit Contracts)	6,571	0.05	1,237	0.01	5,334	431.20
1. 信用違約交換(Credit Default Swap)	6,571	0.05	1,237	0.01	5,334	431.20
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	13,986,038	100.00	14,535,390	100.00	-549,352	-3.78

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。

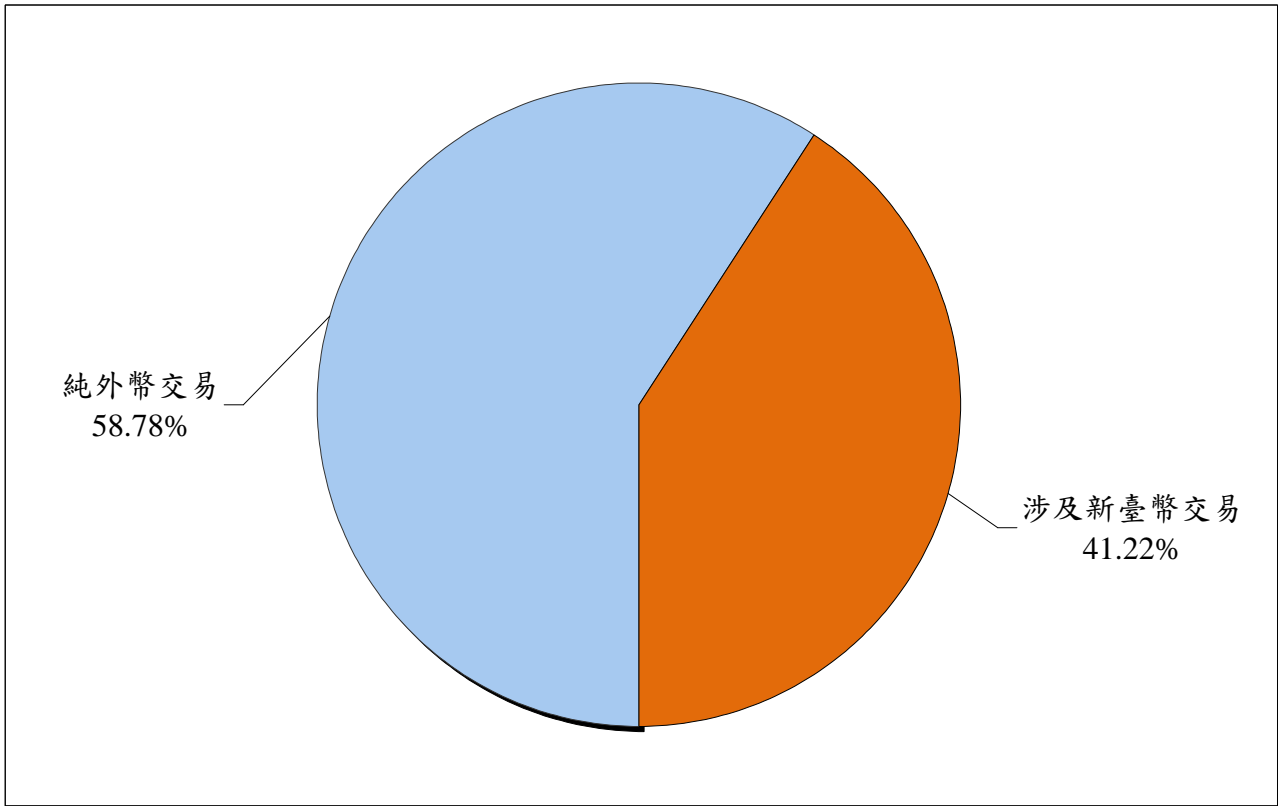
2. 「匯率有關—遠期契約」中「涉及新臺幣交易」金額包括新臺幣對外幣無本金交割遠期外匯交易；「純外幣交易」金額包括外幣保證金交易以遠期契約承作者。

附圖1 銀行辦理衍生性金融商品交易量統計



附圖2 103年10月銀行衍生性金融商品交易量內容分析

幣別



銀行類別

