

# 附表1 銀行衍生性金融商品交易量彙總表

102年11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 <sup>1</sup> |                  |                   |               |
|------------------------------------------------|----------------------------|------------------|-------------------|---------------|
|                                                | 涉及新臺幣交易                    | 純外幣交易            | 合 計               | 比重            |
| <b>一、利率有關契約(Interest Rate Contracts)</b>       | <b>78,818</b>              | <b>320,369</b>   | <b>399,187</b>    | <b>3.47</b>   |
| (一)店頭市場(OTC)                                   | 78,818                     | 38,575           | 117,393           | 1.02          |
| 1. 遠期利率協議(FRA)                                 | -                          | -                | -                 | -             |
| 2. 換利(IRS)                                     | 64,292                     | 34,082           | 98,374            | 0.86          |
| 3. 買入選擇權(Bought Options)                       | 11,015                     | 812              | 11,827            | 0.10          |
| 4. 賣出選擇權(Sold Options)                         | 3,511                      | 3,681            | 7,192             | 0.06          |
| (二)交易所(Exchange-traded Contracts)              | -                          | 281,794          | 281,794           | 2.45          |
| 1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)            | -                          | 142,165          | 142,165           | 1.24          |
| 2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)           | -                          | 139,629          | 139,629           | 1.21          |
| 3. 買入選擇權(Bought Options)                       | -                          | -                | -                 | -             |
| 4. 賣出選擇權(Sold Options)                         | -                          | -                | -                 | -             |
| <b>二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)</b> | <b>4,806,109</b>           | <b>5,934,899</b> | <b>10,741,008</b> | <b>93.50</b>  |
| (一)店頭市場(OTC)                                   | 4,806,109                  | 5,934,899        | 10,741,008        | 93.50         |
| 1. 遠期契約(Outright Forwards) <sup>2</sup>        | 256,216                    | 725,890          | 982,106           | 8.55          |
| 2. 換匯(Fx Swaps)                                | 4,422,327                  | 2,922,077        | 7,344,404         | 63.93         |
| 3. 換匯換利(Currency Swaps)                        | 87,160                     | 6,236            | 93,396            | 0.81          |
| 4. 買入選擇權(Bought Options)                       | 22,649                     | 1,130,551        | 1,153,200         | 10.04         |
| 5. 賣出選擇權(Sold Options)                         | 17,757                     | 1,150,145        | 1,167,902         | 10.17         |
| (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)                         | -                          | -                | -                 | -             |
| <b>三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)</b>     | <b>325,325</b>             | <b>5,828</b>     | <b>331,153</b>    | <b>2.89</b>   |
| (一)店頭市場(OTC)                                   | 112                        | 1,673            | 1,785             | 0.02          |
| (二)交易所(Exchange-traded Contracts)              | 325,213                    | 4,155            | 329,368           | 2.87          |
| <b>四、商品有關契約(Commodity Contracts)</b>           | <b>946</b>                 | <b>14,327</b>    | <b>15,273</b>     | <b>0.13</b>   |
| (一)店頭市場(OTC)                                   | -                          | 9,754            | 9,754             | 0.08          |
| (二)交易所(Exchange-traded Contracts)              | 946                        | 4,573            | 5,519             | 0.05          |
| <b>小 計(一至四)</b>                                | <b>5,211,198</b>           | <b>6,275,423</b> | <b>11,486,621</b> | <b>99.99</b>  |
| <b>五、信用有關契約(Credit Contracts)</b>              | <b>-</b>                   | <b>903</b>       | <b>903</b>        | <b>0.01</b>   |
| 1. 信用違約交換(Credit Default Swap)                 | -                          | 903              | 903               | 0.01          |
| 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)                                   | -                          | -                | -                 | -             |
| <b>六、其他有關契約(Other Contracts)</b>               | <b>-</b>                   | <b>-</b>         | <b>-</b>          | <b>-</b>      |
| 1. 遠期契約(Outright Forwards)                     | -                          | -                | -                 | -             |
| 2. 交換(Swaps)                                   | -                          | -                | -                 | -             |
| 3. 選擇權(Options)                                | -                          | -                | -                 | -             |
| <b>總 計</b>                                     | <b>5,211,198</b>           | <b>6,276,326</b> | <b>11,487,524</b> | <b>100.00</b> |

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

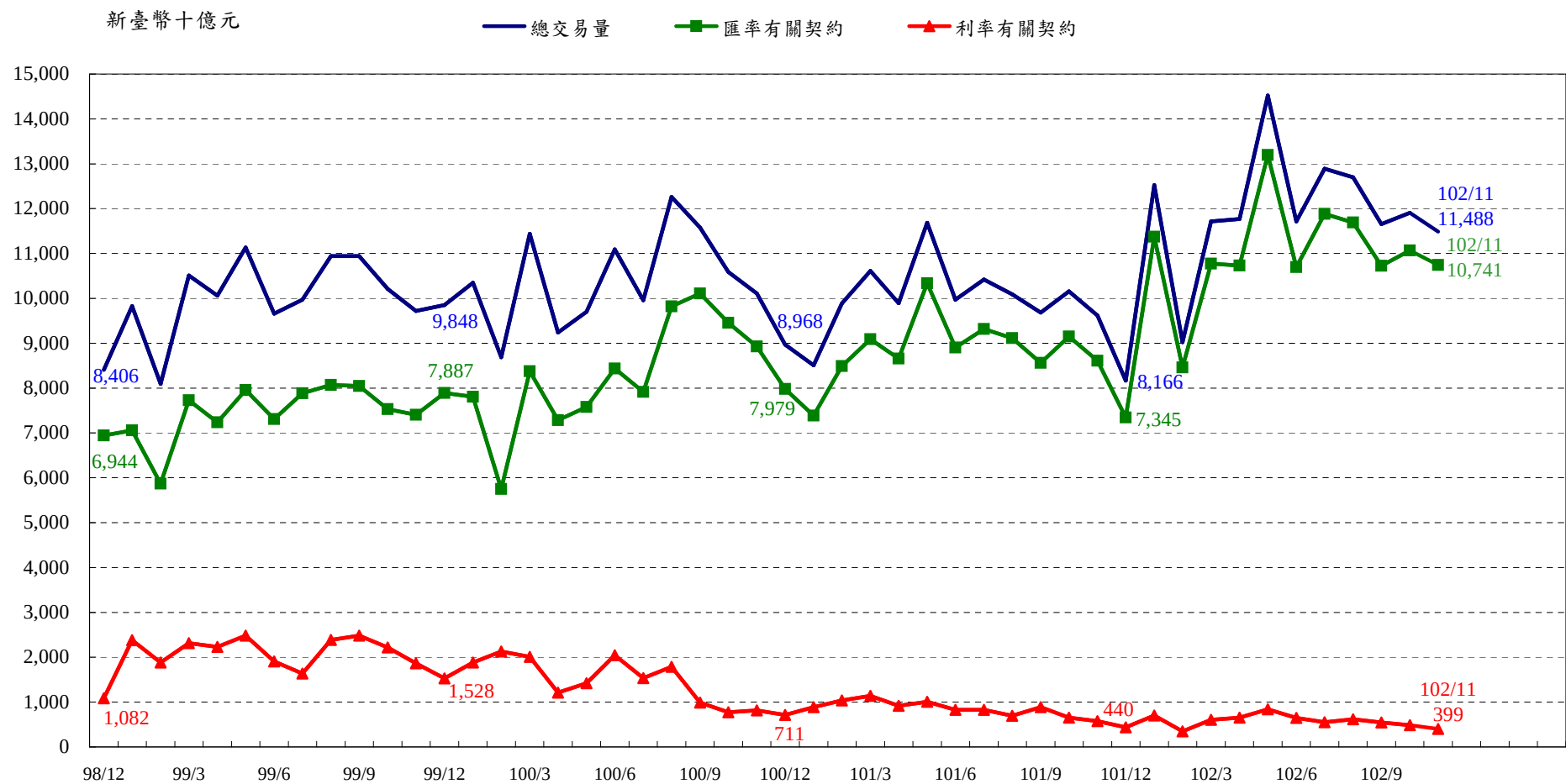
單位：新臺幣百萬元；%

| 商 品 種 類                                         | 102年11月         |        | 102年10月    |        | 比較增減     |        |
|-------------------------------------------------|-----------------|--------|------------|--------|----------|--------|
|                                                 | 合計 <sup>1</sup> | 比重     | 合計         | 比重     | 差 額      | 變動率    |
| <b>一、利率有關契約</b> (Interest Rate Contracts)       | 399,187         | 3.47   | 486,340    | 4.08   | -87,153  | -17.92 |
| (一)店頭市場(OTC)                                    | 117,393         | 1.02   | 134,947    | 1.13   | -17,554  | -13.01 |
| 1. 遠期利率協議(FRA)                                  | -               | -      | -          | -      | -        | -      |
| 2. 換利(IRS)                                      | 98,374          | 0.86   | 121,574    | 1.02   | -23,200  | -19.08 |
| 3. 買入選擇權(Bought Options)                        | 11,827          | 0.10   | 10,134     | 0.08   | 1,693    | 16.71  |
| 4. 賣出選擇權(Sold Options)                          | 7,192           | 0.06   | 3,239      | 0.03   | 3,953    | 122.04 |
| (二)交易所(Exchange-traded Contracts)               | 281,794         | 2.45   | 351,393    | 2.95   | -69,599  | -19.81 |
| 1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)             | 142,165         | 1.24   | 175,042    | 1.47   | -32,877  | -18.78 |
| 2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)            | 139,629         | 1.21   | 176,351    | 1.48   | -36,722  | -20.82 |
| 3. 買入選擇權(Bought Options)                        | -               | -      | -          | -      | -        | -      |
| 4. 賣出選擇權(Sold Options)                          | -               | -      | -          | -      | -        | -      |
| <b>二、匯率有關契約</b> (Foreign Exchange Transactions) | 10,741,008      | 93.50  | 11,067,561 | 92.99  | -326,553 | -2.95  |
| (一)店頭市場(OTC)                                    | 10,741,008      | 93.50  | 11,067,561 | 92.99  | -326,553 | -2.95  |
| 1. 遠期契約(Outright Forwards) <sup>2</sup>         | 982,106         | 8.55   | 917,614    | 7.71   | 64,492   | 7.03   |
| 2. 換匯(Fx Swaps)                                 | 7,344,404       | 63.93  | 7,220,104  | 60.66  | 124,300  | 1.72   |
| 3. 換匯換利(Currency Swaps)                         | 93,396          | 0.81   | 76,805     | 0.65   | 16,591   | 21.60  |
| 4. 買入選擇權(Bought Options)                        | 1,153,200       | 10.04  | 1,412,036  | 11.86  | -258,836 | -18.33 |
| 5. 賣出選擇權(Sold Options)                          | 1,167,902       | 10.17  | 1,441,002  | 12.11  | -273,100 | -18.95 |
| (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)                          | -               | -      | -          | -      | -        | -      |
| <b>三、權益證券有關契約</b> (Equity-linked Contracts)     | 331,153         | 2.89   | 325,595    | 2.73   | 5,558    | 1.71   |
| (一)店頭市場(OTC)                                    | 1,785           | 0.02   | 2,942      | 0.02   | -1,157   | -39.33 |
| (二)交易所(Exchange-traded Contracts)               | 329,368         | 2.87   | 322,653    | 2.71   | 6,715    | 2.08   |
| <b>四、商品有關契約</b> (Commodity Contracts)           | 15,273          | 0.13   | 23,701     | 0.20   | -8,428   | -35.56 |
| (一)店頭市場(OTC)                                    | 9,754           | 0.08   | 11,938     | 0.10   | -2,184   | -18.29 |
| (二)交易所(Exchange-traded Contracts)               | 5,519           | 0.05   | 11,763     | 0.10   | -6,244   | -53.08 |
| <b>小 計(一至四)</b>                                 | 11,486,621      | 99.99  | 11,903,197 | 100.00 | -416,576 | -3.50  |
| <b>五、信用有關契約</b> (Credit Contracts)              | 903             | 0.01   | 349        | -      | 554      | 158.74 |
| 1. 信用違約交換(Credit Default Swap)                  | 903             | 0.01   | 349        | -      | 554      | 158.74 |
| 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)                                    | -               | -      | -          | -      | -        | -      |
| <b>六、其他有關契約</b> (Other Contracts)               | -               | -      | -          | -      | -        | -      |
| 1. 遠期契約(Outright Forwards)                      | -               | -      | -          | -      | -        | -      |
| 2. 交換(Swaps)                                    | -               | -      | -          | -      | -        | -      |
| 3. 選擇權(Options)                                 | -               | -      | -          | -      | -        | -      |
| <b>總 計</b>                                      | 11,487,524      | 100.00 | 11,903,546 | 100.00 | -416,022 | -3.49  |

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。

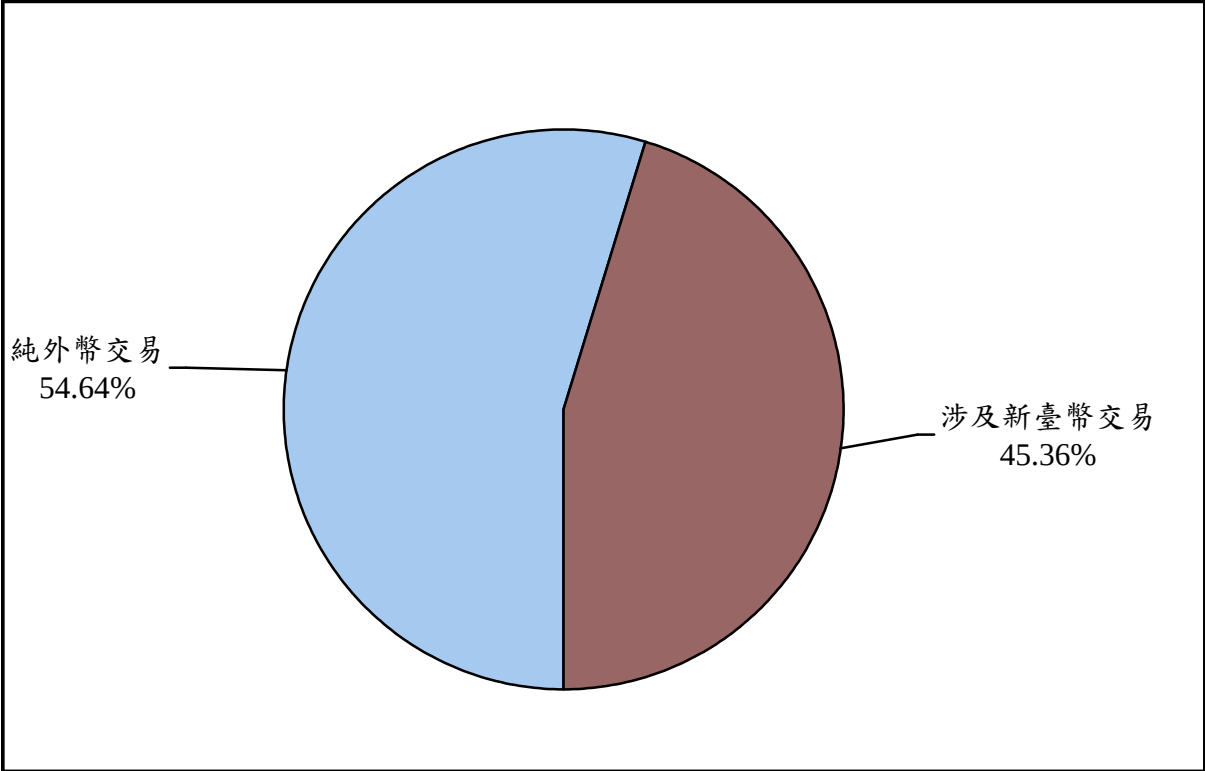
2. 「匯率有關—遠期契約」中「涉及新臺幣交易」金額包括新臺幣對外幣無本金交割遠期外匯交易；「純外幣交易」金額包括外幣保證金交易以遠期契約承作者。

附圖1 102年11月銀行辦理衍生性金融商品交易量統計



附圖2 102年11月銀行衍生性金融商品交易量內容分析

幣別



銀行類別

