

# 附表1 銀行衍生性金融商品交易量彙總表

103年8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>112,071</b>             | <b>417,406</b>   | <b>529,477</b>    | <b>4.44</b>   |
| (一)店頭市場(OTC)                                   | 112,071                    | 72,309           | 184,380           | 1.55          |
| 1.遠期利率協議(FRA)                                  | -                          | -                | -                 | -             |
| 2.換利(IRS)                                      | 87,556                     | 70,587           | 158,143           | 1.33          |
| 3.買入選擇權(Bought Options)                        | 8,547                      | -                | 8,547             | 0.07          |
| 4.賣出選擇權(Sold Options)                          | 15,968                     | 1,722            | 17,690            | 0.15          |
| (二)交易所(Exchange-traded Contracts)              | -                          | 345,097          | 345,097           | 2.89          |
| 1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)             | -                          | 143,530          | 143,530           | 1.20          |
| 2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)            | -                          | 149,532          | 149,532           | 1.25          |
| 3.買入選擇權(Bought Options)                        | -                          | 28,490           | 28,490            | 0.24          |
| 4.賣出選擇權(Sold Options)                          | -                          | 23,545           | 23,545            | 0.20          |
| <b>二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)</b> | <b>4,603,252</b>           | <b>6,331,052</b> | <b>10,934,304</b> | <b>91.65</b>  |
| (一)店頭市場(OTC)                                   | 4,603,252                  | 6,331,052        | 10,934,304        | 91.65         |
| 1.遠期契約(Outright Forwards) <sup>2</sup>         | 220,251                    | 628,204          | 848,455           | 7.11          |
| 2.換匯(Fx Swaps)                                 | 4,239,937                  | 3,092,070        | 7,332,007         | 61.45         |
| 3.換匯換利(Currency Swaps)                         | 83,805                     | 10,393           | 94,198            | 0.79          |
| 4.買入選擇權(Bought Options)                        | 29,742                     | 1,302,352        | 1,332,094         | 11.17         |
| 5.賣出選擇權(Sold Options)                          | 29,517                     | 1,298,033        | 1,327,550         | 11.13         |
| (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>424,932</b>             | <b>16,713</b>    | <b>441,645</b>    | <b>3.70</b>   |
| (一)店頭市場(OTC)                                   | 266                        | 311              | 577               | -             |
| (二)交易所(Exchange-traded Contracts)              | 424,666                    | 16,402           | 441,068           | 3.70          |
| <b>四、商品有關契約(Commodity Contracts)</b>           | <b>684</b>                 | <b>19,700</b>    | <b>20,384</b>     | <b>0.17</b>   |
| (一)店頭市場(OTC)                                   | -                          | 11,840           | 11,840            | 0.10          |
| (二)交易所(Exchange-traded Contracts)              | 684                        | 7,860            | 8,544             | 0.07          |
| <b>小 計(一至四)</b>                                | <b>5,140,939</b>           | <b>6,784,871</b> | <b>11,925,810</b> | <b>99.96</b>  |
| <b>五、信用有關契約(Credit Contracts)</b>              | <b>-</b>                   | <b>5,361</b>     | <b>5,361</b>      | <b>0.04</b>   |
| 1.信用違約交換(Credit Default Swap)                  | -                          | 5,361            | 5,361             | 0.04          |
| 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>5,140,939</b>           | <b>6,790,232</b> | <b>11,931,171</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

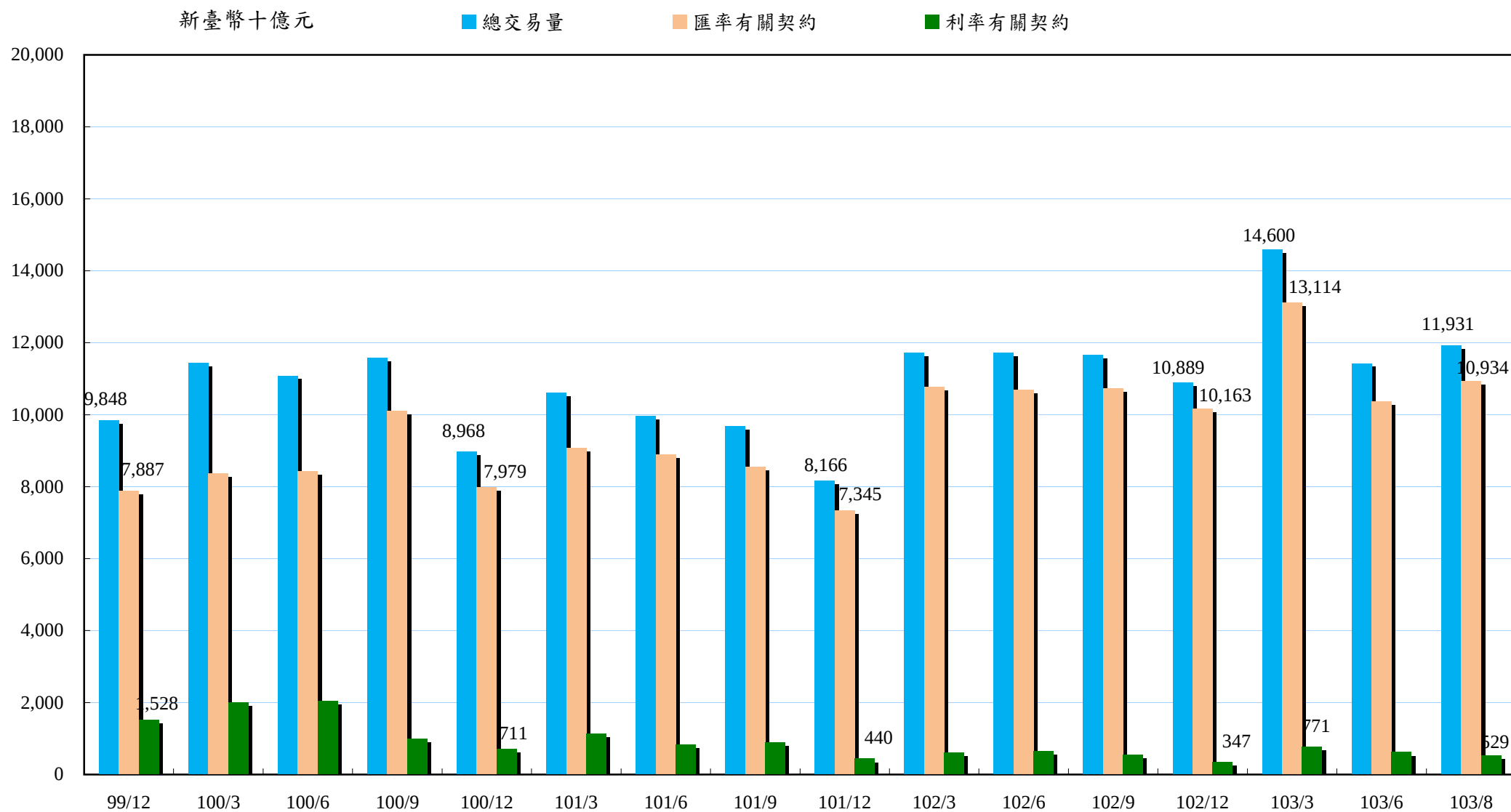
單位：新臺幣百萬元；%

| 商 品 種 類                                        | 103年8月          |        | 103年7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(Interest Rate Contracts)</b>       | 529,477         | 4.44   | 700,966    | 5.44   | -171,489 | -24.46 |
| (一)店頭市場(OTC)                                   | 184,380         | 1.55   | 121,267    | 0.94   | 63,113   | 52.04  |
| 1. 遠期利率協議(FRA)                                 | -               | -      | -          | -      | -        | -      |
| 2. 換利(IRS)                                     | 158,143         | 1.33   | 111,695    | 0.87   | 46,448   | 41.58  |
| 3. 買入選擇權(Bought Options)                       | 8,547           | 0.07   | 3,123      | 0.02   | 5,424    | 173.68 |
| 4. 賣出選擇權(Sold Options)                         | 17,690          | 0.15   | 6,449      | 0.05   | 11,241   | 174.31 |
| (二)交易所(Exchange-traded Contracts)              | 345,097         | 2.89   | 579,699    | 4.50   | -234,602 | -40.47 |
| 1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)            | 143,530         | 1.20   | 276,681    | 2.15   | -133,151 | -48.12 |
| 2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)           | 149,532         | 1.25   | 278,235    | 2.16   | -128,703 | -46.26 |
| 3. 買入選擇權(Bought Options)                       | 28,490          | 0.24   | 7,510      | 0.06   | 20,980   | 279.36 |
| 4. 賣出選擇權(Sold Options)                         | 23,545          | 0.20   | 17,273     | 0.13   | 6,272    | 36.31  |
| <b>二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)</b> | 10,934,304      | 91.65  | 11,467,656 | 90.01  | -533,352 | -4.65  |
| (一)店頭市場(OTC)                                   | 10,934,304      | 91.65  | 11,467,656 | 90.01  | -533,352 | -4.65  |
| 1. 遠期契約(Outright Forwards) <sup>2</sup>        | 848,455         | 7.11   | 910,281    | 7.06   | -61,826  | -6.79  |
| 2. 換匯(Fx Swaps)                                | 7,332,007       | 61.45  | 8,231,126  | 63.83  | -899,119 | -10.92 |
| 3. 換匯換利(Currency Swaps)                        | 94,198          | 0.79   | 80,403     | 0.62   | 13,795   | 17.16  |
| 4. 買入選擇權(Bought Options)                       | 1,332,094       | 11.17  | 1,101,311  | 9.08   | 230,783  | 20.96  |
| 5. 賣出選擇權(Sold Options)                         | 1,327,550       | 11.13  | 1,144,535  | 9.42   | 183,015  | 15.99  |
| (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>     | 441,645         | 3.70   | 541,490    | 4.20   | -99,845  | -18.44 |
| (一)店頭市場(OTC)                                   | 577             | -      | 2,675      | 0.02   | -2,098   | -78.43 |
| (二)交易所(Exchange-traded Contracts)              | 441,068         | 3.70   | 538,815    | 4.18   | -97,747  | -18.14 |
| <b>四、商品有關契約(Commodity Contracts)</b>           | 20,384          | 0.17   | 42,307     | 0.33   | -21,923  | -51.82 |
| (一)店頭市場(OTC)                                   | 11,840          | 0.10   | 11,364     | 0.09   | 476      | 4.19   |
| (二)交易所(Exchange-traded Contracts)              | 8,544           | 0.07   | 30,943     | 0.24   | -22,399  | -72.39 |
| <b>小 計(一至四)</b>                                | 11,925,810      | 99.96  | 12,752,419 | 99.98  | -826,609 | -6.48  |
| <b>五、信用有關契約(Credit Contracts)</b>              | 5,361           | 0.04   | 3,012      | 0.02   | 2,349    | 77.99  |
| 1. 信用違約交換(Credit Default Swap)                 | 5,361           | 0.04   | 3,012      | 0.02   | 2,349    | 77.99  |
| 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)                                   | -               | -      | -          | -      | -        | -      |
| <b>六、其他有關契約(Other Contracts)</b>               | -               | -      | -          | -      | -        | -      |
| 1. 遠期契約(Outright Forwards)                     | -               | -      | -          | -      | -        | -      |
| 2. 交換(Swaps)                                   | -               | -      | -          | -      | -        | -      |
| 3. 選擇權(Options)                                | -               | -      | -          | -      | -        | -      |
| <b>總 計</b>                                     | 11,931,171      | 100.00 | 12,755,431 | 100.00 | -824,260 | -6.46  |

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。

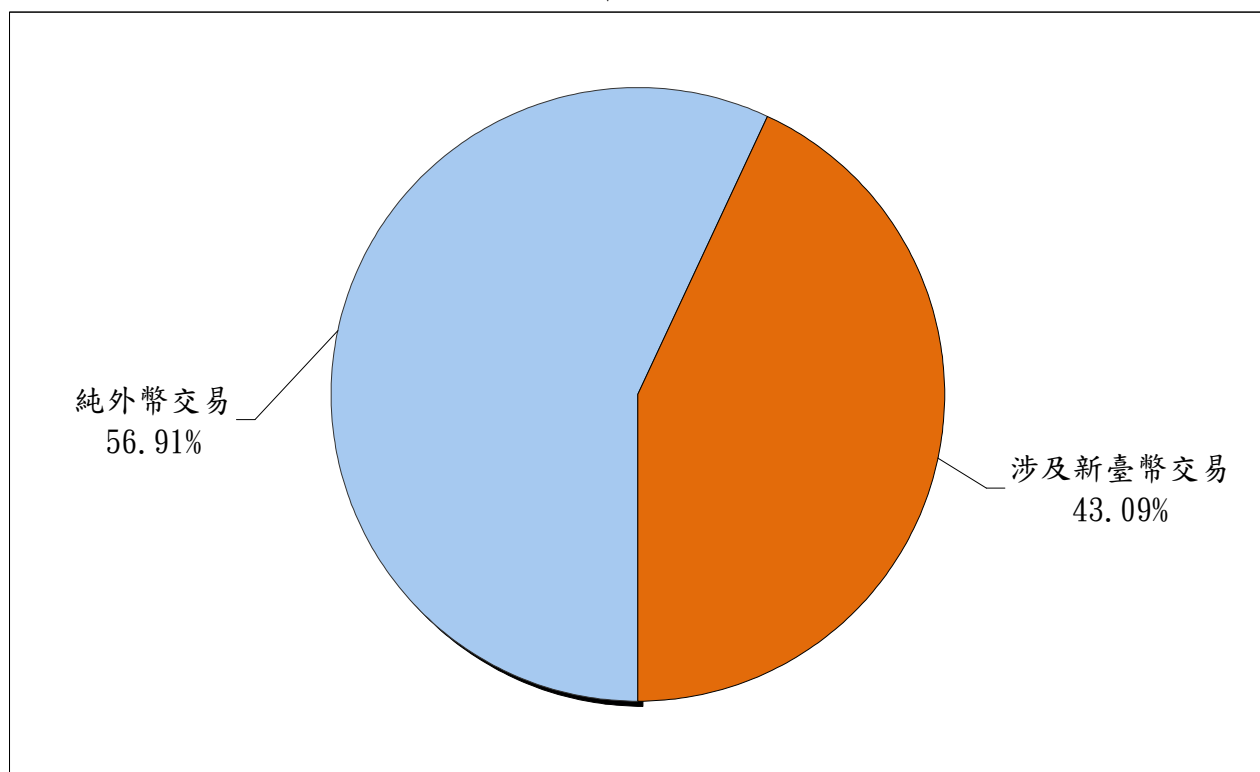
2. 「匯率有關—遠期契約」中「涉及新臺幣交易」金額包括新臺幣對外幣無本金交割遠期外匯交易；「純外幣交易」金額包括外幣保證金交易以遠期契約承作者。

# 附圖1 銀行辦理衍生性金融商品交易量統計



附圖2 103年8月銀行衍生性金融商品交易量內容分析

幣別



銀行類別

