

附表1 銀行衍生性金融商品交易量彙總表

104年2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)	50,966	265,372	316,338	3.18
(一)店頭市場(OTC)	50,966	44,627	95,593	0.96
1.遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-
2.換利(IRS)	47,608	42,863	90,471	0.91
3.買入選擇權(Bought Options)	1,004	-	1,004	0.01
4.賣出選擇權(Sold Options)	2,354	1,764	4,118	0.04
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	220,745	220,745	2.22
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	-	109,210	109,210	1.10
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	-	111,535	111,535	1.12
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)	3,752,819	5,630,330	9,383,149	94.24
(一)店頭市場(OTC)	3,752,819	5,630,330	9,383,149	94.24
1.遠期契約(Outright Forwards) ²	259,608	882,627	1,142,235	11.47
2.換匯(Fx Swaps)	3,394,377	3,078,062	6,472,439	65.01
3.換匯換利(Currency Swaps)	37,278	5,151	42,429	0.43
4.買入選擇權(Bought Options)	31,558	844,083	875,641	8.79
5.賣出選擇權(Sold Options)	29,998	820,407	850,405	8.54
(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)	216,469	4,239	220,708	2.21
(一)店頭市場(OTC)	393	1,008	1,401	0.01
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	216,076	3,231	219,307	2.20
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	673	35,399	36,072	0.36
(一)店頭市場(OTC)	-	7,896	7,896	0.08
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	673	27,503	28,176	0.28
小 計(一至四)	4,020,927	5,935,340	9,956,267	99.99
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	504	504	0.01
1.信用違約交換(Credit Default Swap)	-	504	504	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)	-	-	-	-
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	4,020,927	5,935,844	9,956,771	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	104年2月		104年1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)	316,338	3.18	523,034	3.46	-206,696	-39.52
(一)店頭市場(OTC)	95,593	0.96	213,870	1.42	-118,277	-55.30
1. 遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-	-	-
2. 換利(IRS)	90,471	0.91	205,541	1.36	-115,070	-55.98
3. 買入選擇權(Bought Options)	1,004	0.01	943	0.01	61	6.47
4. 賣出選擇權(Sold Options)	4,118	0.04	7,386	0.05	-3,268	-44.25
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	220,745	2.22	309,164	2.04	-88,419	-28.60
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	109,210	1.10	160,217	1.06	-51,007	-31.84
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	111,535	1.12	148,947	0.98	-37,412	-25.12
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)	9,383,149	94.24	14,134,246	93.30	-4,751,097	-33.61
(一)店頭市場(OTC)	9,383,149	94.24	14,134,246	93.30	-4,751,097	-33.61
1. 遠期契約(Outright Forwards) ²	1,142,235	11.47	1,377,341	9.09	-235,106	-17.07
2. 換匯(Fx Swaps)	6,472,439	65.01	8,869,790	58.55	-2,397,351	-27.03
3. 換匯換利(Currency Swaps)	42,429	0.43	98,971	0.65	-56,542	-57.13
4. 買入選擇權(Bought Options)	875,641	8.79	1,918,720	12.67	-1,043,079	-54.36
5. 賣出選擇權(Sold Options)	850,405	8.54	1,869,424	12.34	-1,019,019	-54.51
(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)	220,708	2.21	442,494	2.92	-221,786	-50.12
(一)店頭市場(OTC)	1,401	0.01	1,412	0.01	-11	-0.78
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	219,307	2.20	441,082	2.91	-221,775	-50.28
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	36,072	0.36	39,806	0.26	-3,734	-9.38
(一)店頭市場(OTC)	7,896	0.08	14,359	0.09	-6,463	-45.01
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	28,176	0.28	25,447	0.17	2,729	10.72
小 計(一至四)	9,956,267	99.99	15,139,580	99.94	-5,183,313	-34.24
五、信用有關契約(Credit Contracts)	504	0.01	9,753	0.06	-9,249	-94.83
1. 信用違約交換(Credit Default Swap)	504	0.01	9,753	0.06	-9,249	-94.83
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	9,956,771	100.00	15,149,333	100.00	-5,192,562	-34.28

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。

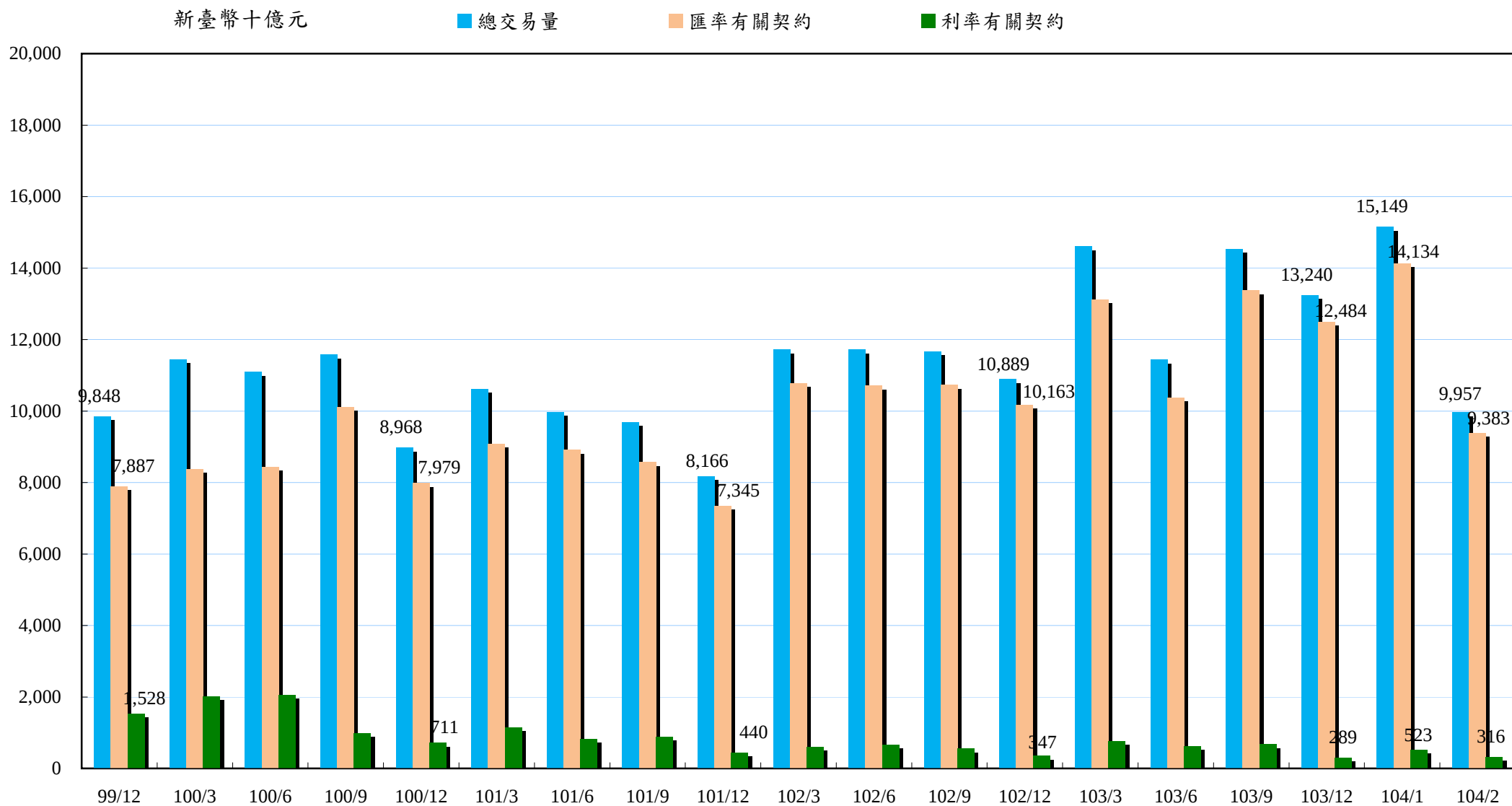
2. 「匯率有關—遠期契約」中「涉及新臺幣交易」金額包括新臺幣對外幣無本金交割遠期外匯交易；「純外幣交易」金額包括外幣保證金交易以遠期契約承作者。

附表3 銀行衍生性金融商品交易幣別比較表

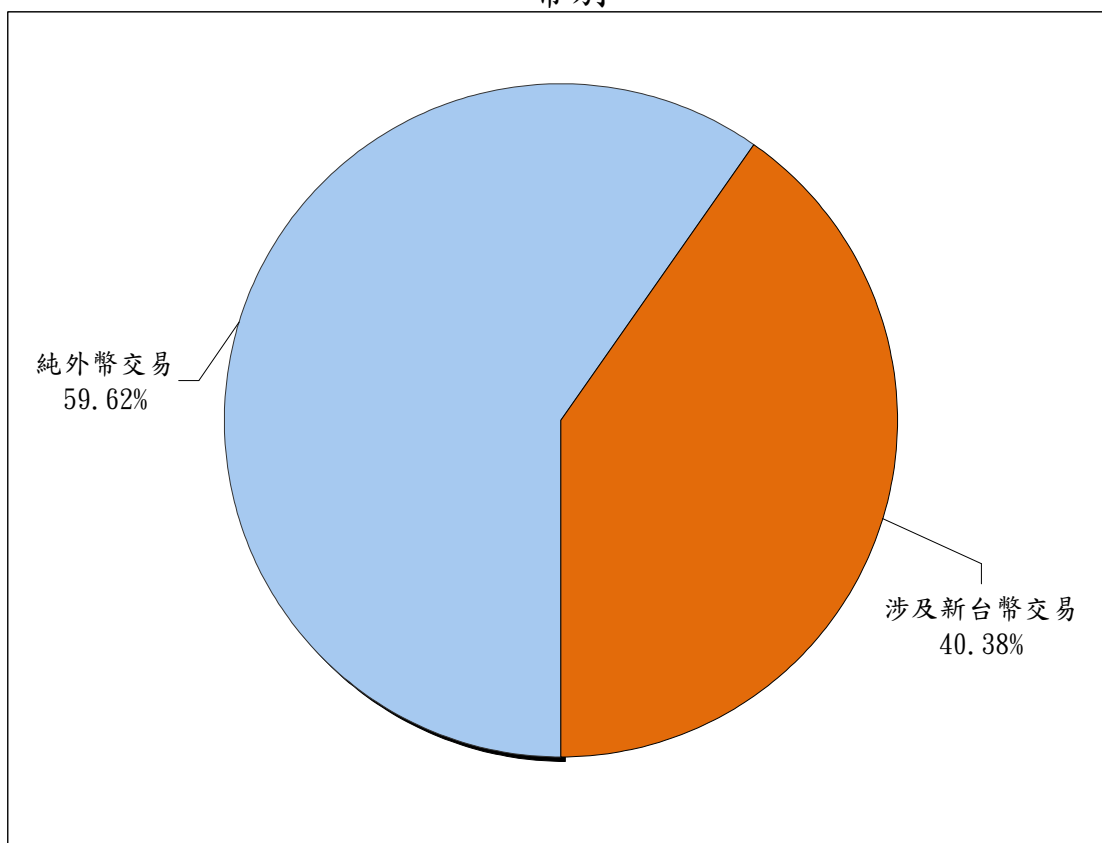
單位：新臺幣百萬元；%

商 品 種 類	104年2月		104年1月		比較增減	
	金額	比重	金額	比重	差 額	變動率
涉及新臺幣交易量	4, 020, 927	40. 38	5, 798, 427	38. 28	-1, 777, 500	-30. 65
一、利率有關契約(Interest Rate Contracts)	50, 966	0. 51	97, 591	0. 64	-46, 625	-47. 78
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	3, 752, 819	37. 69	5, 276, 379	34. 83	-1, 523, 560	-28. 88
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	216, 469	2. 17	423, 666	2. 80	-207, 197	-48. 91
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	673	0. 01	791	0. 01	-118	-14. 92
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	-	-	-	-	-
六、其他有關契約(Other Contracts)	-	-	-	-	-	-
純外幣交易量	5, 935, 844	59. 62	9, 350, 906	61. 72	-3, 415, 062	-36. 52
一、利率有關契約(Interest Rate Contracts)	265, 372	2. 67	425, 443	2. 81	-160, 071	-37. 62
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	5, 630, 330	56. 55	8, 857, 867	58. 47	-3, 227, 537	-36. 44
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	4, 239	0. 04	18, 828	0. 12	-14, 589	-77. 49
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	35, 399	0. 35	39, 015	0. 26	-3, 616	-9. 27
五、信用有關契約(Credit Contracts)	504	0. 01	9, 753	0. 06	-9, 249	-94. 83
六、其他有關契約(Other Contracts)	-	-	-	-	-	-
總 計	9, 956, 771	100. 00	15, 149, 333	100. 00	-5, 192, 562	-34. 28

附圖1 銀行辦理衍生性金融商品交易量統計



附圖2 104年2月銀行衍生性金融商品交易量內容分析
幣別



銀行類別

