

附表1 銀行衍生性金融商品交易量彙總表

101年8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)	111,523	583,185	694,708	6.89
(一)店頭市場(OTC)	111,523	104,318	215,841	2.14
1. 遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-
2. 換利(IRS)	95,086	93,971	189,057	1.87
3. 買入選擇權(Bought Options)	7,048	943	7,991	0.08
4. 賣出選擇權(Sold Options)	9,389	9,404	18,793	0.19
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	478,867	478,867	4.75
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	-	235,877	235,877	2.34
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	-	242,840	242,840	2.41
3. 買入選擇權(Bought Options)	-	-	-	-
4. 賣出選擇權(Sold Options)	-	150	150	-
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	4,682,550	4,430,499	9,113,049	90.34
(一)店頭市場(OTC)	4,682,550	4,430,499	9,113,049	90.34
1. 遠期契約(Outright Forwards)	424,900	572,682	997,582	9.89
2. 換匯(Fx Swaps)	4,172,750	2,261,955	6,434,705	63.79
3. 換匯換利(Currency Swaps)	43,656	1,453	45,109	0.45
4. 買入選擇權(Bought Options)	21,979	792,674	814,653	8.07
5. 賣出選擇權(Sold Options)	19,265	801,735	821,000	8.14
(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)	220,633	8,647	229,280	2.27
(一)店頭市場(OTC)	408	3,028	3,436	0.03
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	220,225	5,619	225,844	2.24
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	2,020	46,041	48,061	0.48
(一)店頭市場(OTC)	-	41,013	41,013	0.41
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	2,020	5,028	7,048	0.07
小 計(一至四)	5,016,726	5,068,372	10,085,098	99.98
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	1,988	1,988	0.02
1. 信用違約交換(Credit Default Swap)	-	1,988	1,988	0.02
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	5,016,726	5,070,360	10,087,086	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8月

單位：新臺幣百萬元，%

商 品 種 類	101年8月		101年7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)	694,708	6.89	827,482	7.94	-132,774	-16.05
(一)店頭市場(OTC)	215,841	2.14	387,496	3.72	-171,655	-44.30
1.遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-	-	-
2.換利(IRS)	189,057	1.87	351,502	3.38	-162,445	-46.21
3.買入選擇權(Bought Options)	7,991	0.08	12,833	0.12	-4,842	-37.73
4.賣出選擇權(Sold Options)	18,793	0.19	23,161	0.22	-4,368	-18.86
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	478,867	4.75	439,986	4.22	38,881	8.84
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	235,877	2.34	223,232	2.14	12,645	5.66
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	242,840	2.41	216,754	2.08	26,086	12.03
3.買入選擇權(Bought Options)	-	-	-	-	-	-
4.賣出選擇權(Sold Options)	150	-	-	-	150	-
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	9,113,049	90.34	9,319,354	89.43	-206,305	-2.21
(一)店頭市場(OTC)	9,113,049	90.34	9,319,354	89.43	-206,305	-2.21
1.遠期契約(Outright Forwards)	997,582	9.89	1,411,702	13.55	-414,120	-29.33
2.換匯(Fx Swaps)	6,434,705	63.79	6,219,180	59.68	215,525	3.47
3.換匯換利(Currency Swaps)	45,109	0.45	72,244	0.69	-27,135	-37.56
4.買入選擇權(Bought Options)	814,653	8.07	803,572	7.71	11,081	1.38
5.賣出選擇權(Sold Options)	821,000	8.14	812,656	7.80	8,344	1.03
(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)	229,280	2.27	222,500	2.14	6,780	3.05
(一)店頭市場(OTC)	3,436	0.03	2,269	0.02	1,167	51.43
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	225,844	2.24	220,231	2.12	5,613	2.55
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	48,061	0.48	49,572	0.48	-1,511	-3.05
(一)店頭市場(OTC)	41,013	0.41	41,273	0.40	-260	-0.63
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	7,048	0.07	8,299	0.08	-1,251	-15.07
小 計(一至四)	10,085,098	99.98	10,418,908	99.99	-333,810	-3.20
五、信用有關契約(Credit Contracts)	1,988	0.02	1,318	0.01	670	50.83
1.信用違約交換(Credit Default Swap)	1,988	0.02	1,318	0.01	670	50.83
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	10,087,086	100.00	10,420,226	100.00	-333,140	-3.20

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。

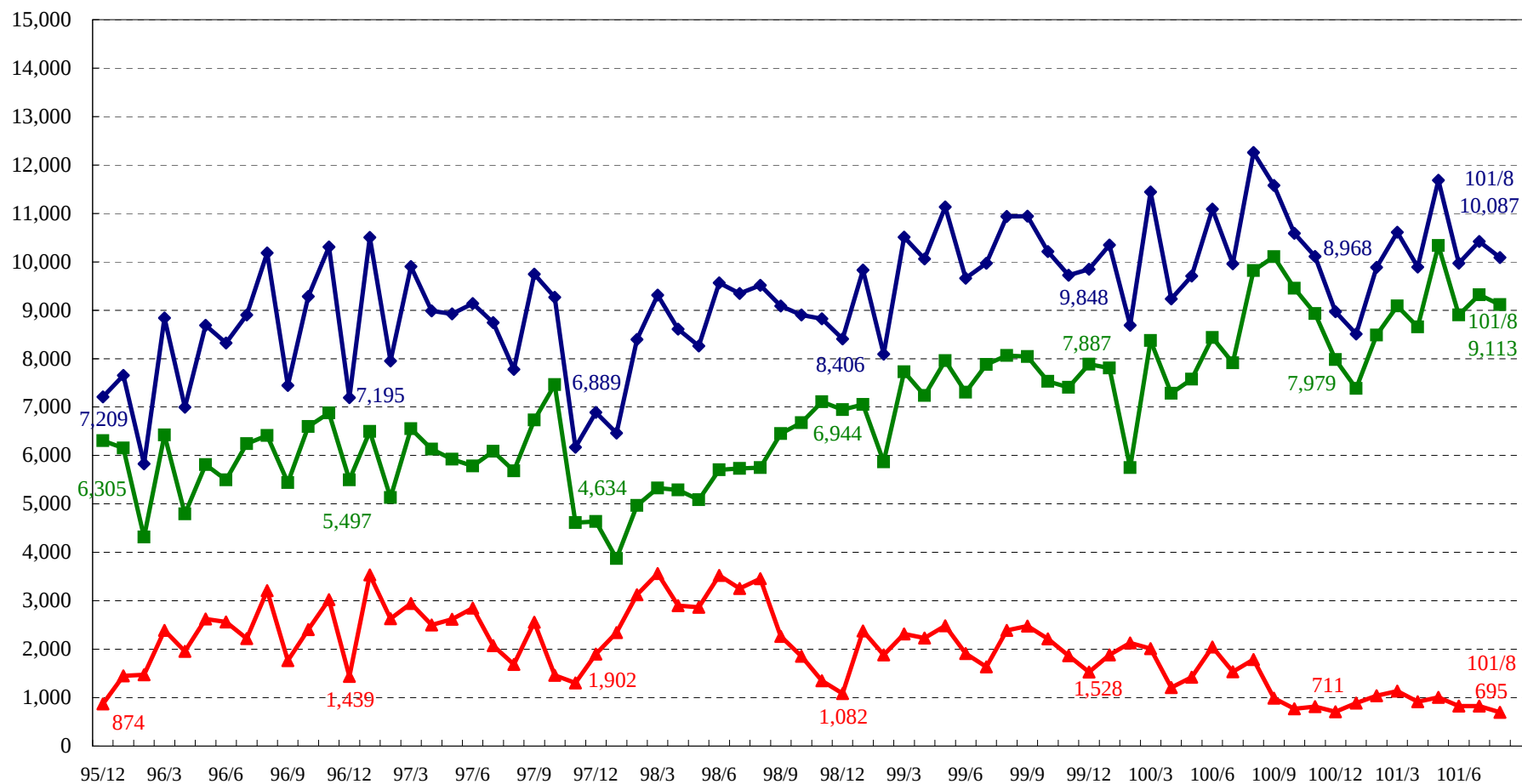
3.「匯率有關—遠期契約」中「涉及新臺幣交易」金額包括新臺幣對外幣無本金交割遠期外匯交易；「純外幣交易」金額包括外幣保證金交易以遠期契約承作者。

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8月銀行辦理衍生性金融商品交易量統計

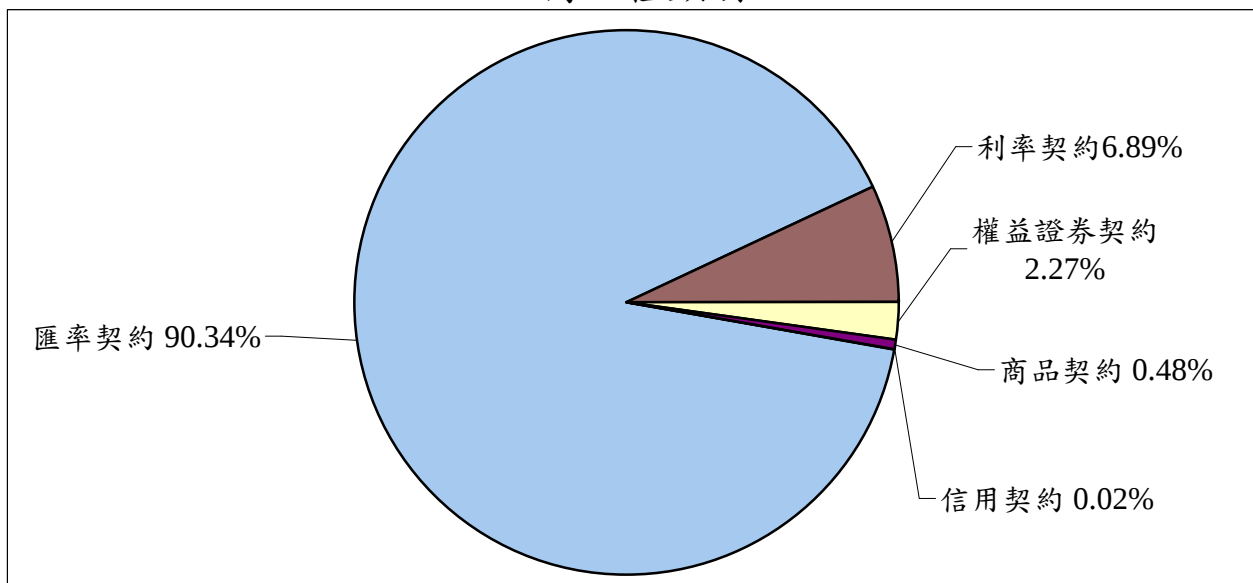
新臺幣十億元

◆ 總交易量 ■ 匯率有關契約 ▲ 利率有關契約

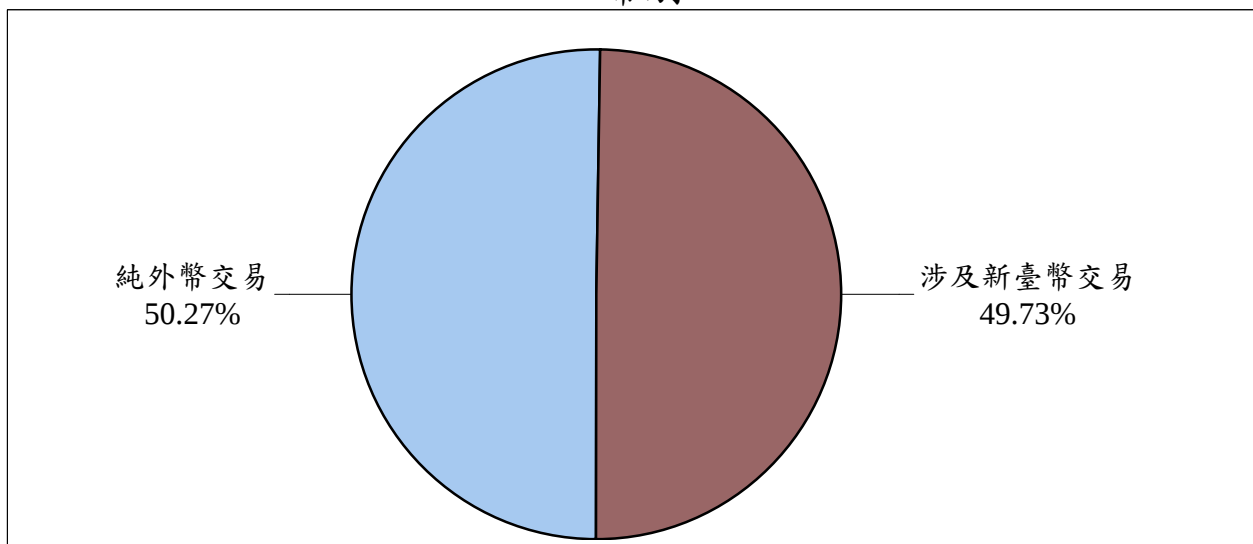


附圖2 101年8月銀行衍生性金融商品交易量內容分析

商品種類別



幣別



銀行類別

