

附表1 銀行衍生性金融商品交易量彙總表

102年1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)	218,194	485,827	704,021	5.62
(一)店頭市場(OTC)	218,194	131,338	349,532	2.79
1.遠期利率協議(FRA)	239	532	771	0.01
2.換利(IRS)	212,604	106,178	318,782	2.55
3.買入選擇權(Bought Options)	1,837	7,429	9,266	0.07
4.賣出選擇權(Sold Options)	3,514	17,199	20,713	0.16
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	354,489	354,489	2.83
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	-	174,304	174,304	1.39
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	-	179,623	179,623	1.43
3.買入選擇權(Bought Options)	-	-	-	-
4.賣出選擇權(Sold Options)	-	562	562	0.01
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	5,101,632	6,272,249	11,373,881	90.82
(一)店頭市場(OTC)	5,101,632	6,272,249	11,373,881	90.82
1.遠期契約(Outright Forwards) ²	513,847	623,885	1,137,732	9.09
2.換匯(Fx Swaps)	4,399,626	2,761,941	7,161,567	57.18
3.換匯換利(Currency Swaps)	71,621	5,323	76,944	0.62
4.買入選擇權(Bought Options)	58,139	1,433,977	1,492,116	11.91
5.賣出選擇權(Sold Options)	58,399	1,447,123	1,505,522	12.02
(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)	390,824	15,245	406,069	3.24
(一)店頭市場(OTC)	901	11,232	12,133	0.10
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	389,923	4,013	393,936	3.14
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	1,137	27,326	28,463	0.23
(一)店頭市場(OTC)	-	21,192	21,192	0.17
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	1,137	6,134	7,271	0.06
小 計(一至四)	5,711,787	6,800,647	12,512,434	99.91
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	11,522	11,522	0.09
1.信用違約交換(Credit Default Swap)	-	11,522	11,522	0.09
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	5,711,787	6,812,169	12,523,956	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

102年1月

單位：新臺幣百萬元，%

商 品 種 類	102年1月		101年12月		比較增減	
	合 計 ¹	比重	合 計	比重	合 計	變動率
一、利率有關契約(Interest Rate Contracts)	704,021	5.62	440,191	5.39	263,830	59.94
(一)店頭市場(OTC)	349,532	2.79	160,896	1.97	188,636	117.24
1. 遠期利率協議(FRA)	771	0.01	-	-	771	-
2. 換利(IRS)	318,782	2.55	150,027	1.84	168,755	112.48
3. 買入選擇權(Bought Options)	9,266	0.07	1,063	0.01	8,203	771.68
4. 賣出選擇權(Sold Options)	20,713	0.16	9,806	0.12	10,907	111.23
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	354,489	2.83	279,295	3.42	75,194	26.92
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	174,304	1.39	136,999	1.68	37,305	27.23
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	179,623	1.43	142,296	1.74	37,327	26.23
3. 買入選擇權(Bought Options)	-	-	-	-	-	-
4. 賣出選擇權(Sold Options)	562	0.01	-	-	562	-
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	11,373,881	90.82	7,345,199	89.95	4,028,682	54.85
(一)店頭市場(OTC)	11,373,881	90.82	7,345,199	89.95	4,028,682	54.85
1. 遠期契約(Outright Forwards) ²	1,137,732	9.09	800,767	9.80	336,965	42.08
2. 換匯(Fx Swaps)	7,161,567	57.18	5,411,134	66.27	1,750,433	32.35
3. 換匯換利(Currency Swaps)	76,944	0.62	59,557	0.73	17,387	29.19
4. 買入選擇權(Bought Options)	1,492,116	11.91	531,561	6.51	960,555	180.70
5. 賣出選擇權(Sold Options)	1,505,522	12.02	542,180	6.64	963,342	177.68
(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)	406,069	3.24	345,721	4.23	60,348	17.46
(一)店頭市場(OTC)	12,133	0.10	2,230	0.03	9,903	444.08
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	393,936	3.14	343,491	4.20	50,445	14.69
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	28,463	0.23	30,709	0.38	-2,246	-7.31
(一)店頭市場(OTC)	21,192	0.17	22,253	0.27	-1,061	-4.77
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	7,271	0.06	8,456	0.11	-1,185	-14.01
小 計(一至四)	12,512,434	99.91	8,161,820	99.95	4,350,614	53.30
五、信用有關契約(Credit Contracts)	11,522	0.09	3,864	0.05	7,658	198.19
1. 信用違約交換(Credit Default Swap)	11,522	0.09	3,864	0.05	7,658	198.19
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	12,523,956	100.00	8,165,684	100.00	4,358,272	53.37

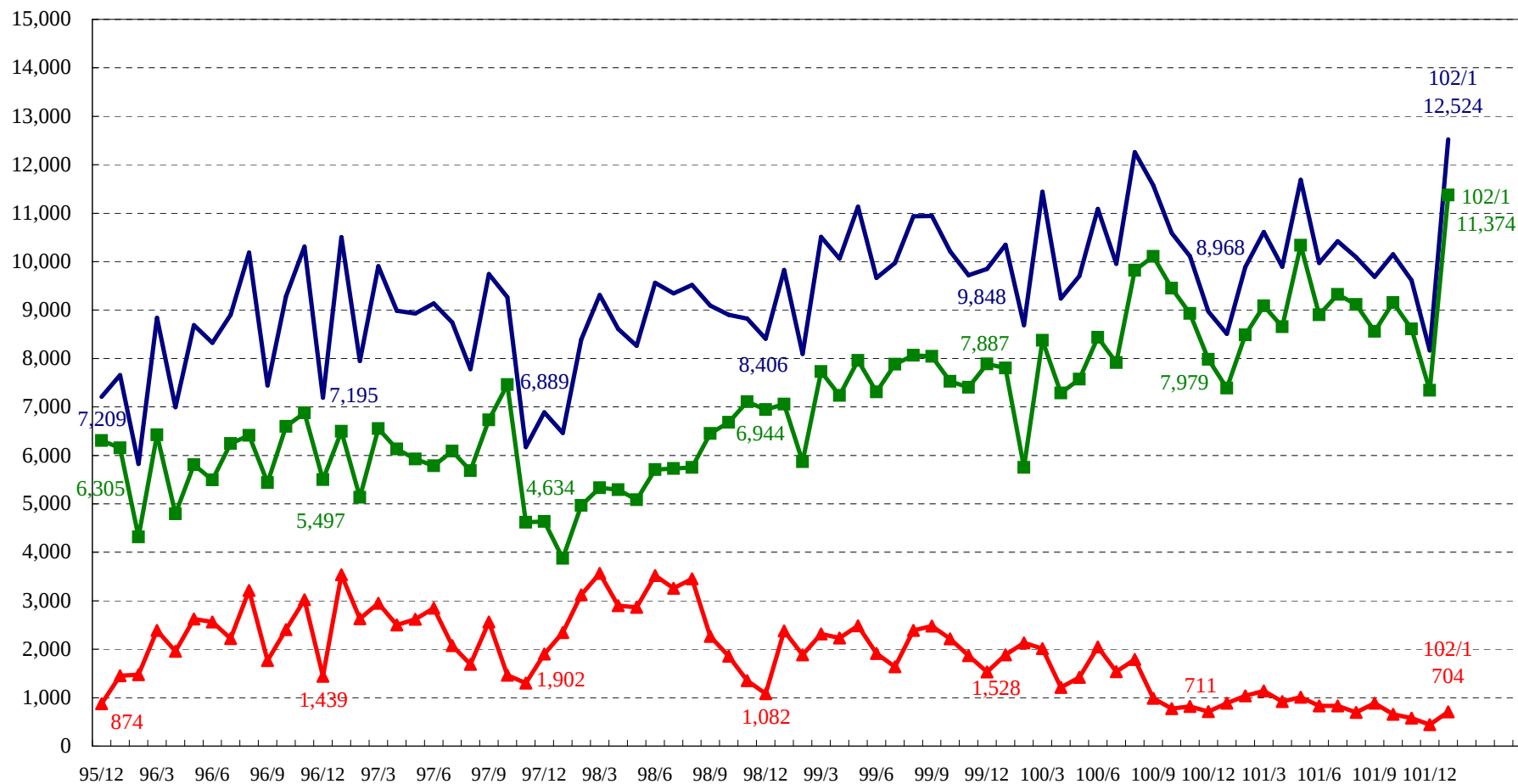
註：1. 包括國內總分支機構及國際金融業務分行資料，不含海外分行及子行；本表已剔除銀行間交易重複計算部分。

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1月銀行辦理衍生性金融商品交易量統計

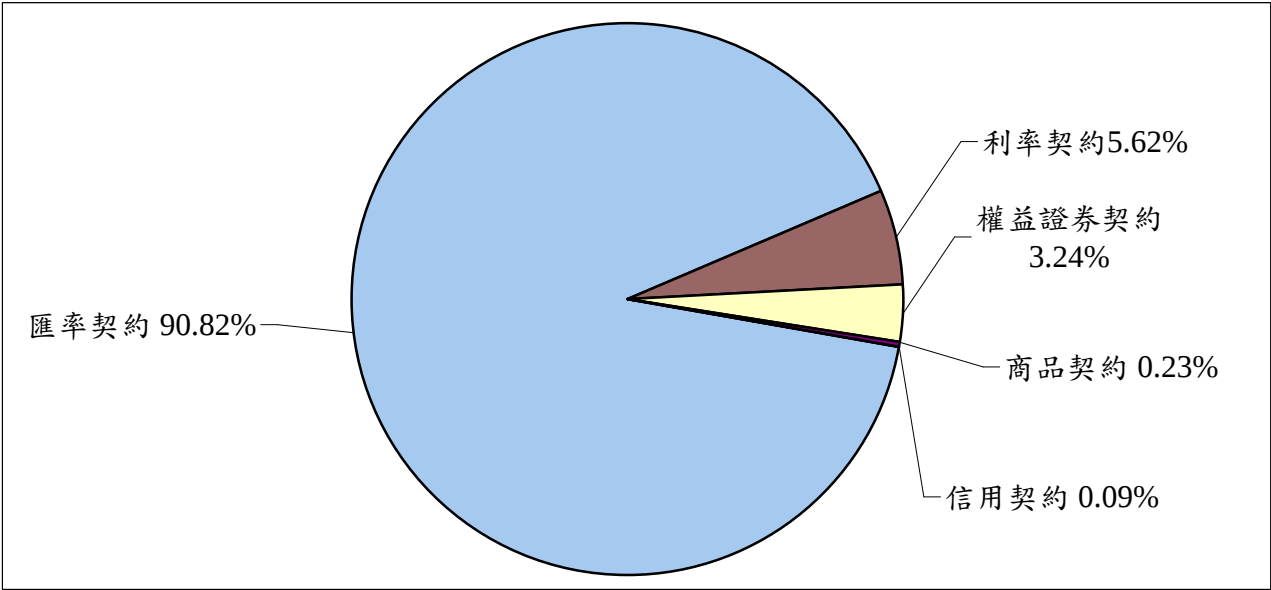
新臺幣十億元

— 總交易量 ■ 匯率有關契約 ▲ 利率有關契約

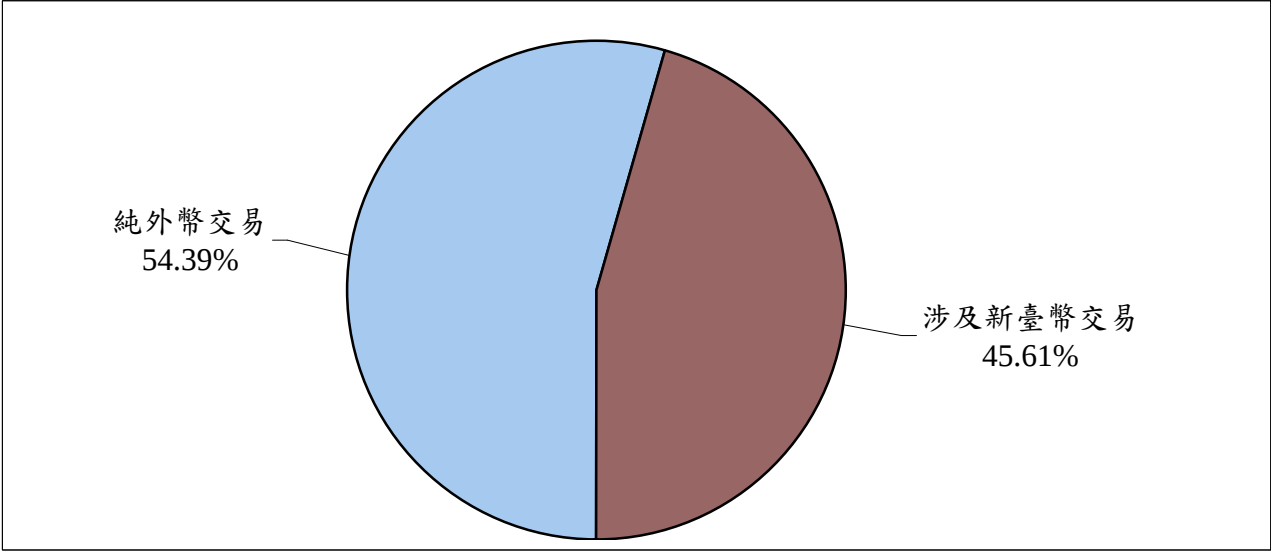


附圖2 102年1月銀行衍生性金融商品交易量內容分析

商品種類別



幣別



銀行類別

