

附表1 銀行衍生性金融商品交易量彙總表

102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)	59,088	288,653	347,741	3.85
(一)店頭市場(OTC)	59,088	50,704	109,792	1.21
1.遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-
2.換利(IRS)	57,131	43,973	101,104	1.12
3.買入選擇權(Bought Options)	1,022	-	1,022	0.01
4.賣出選擇權(Sold Options)	935	6,731	7,666	0.08
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	237,949	237,949	2.64
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	-	115,582	115,582	1.28
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	-	122,367	122,367	1.36
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)	3,581,469	4,878,126	8,459,595	93.79
(一)店頭市場(OTC)	3,581,469	4,878,126	8,459,595	93.79
1.遠期契約(Outright Forwards) ²	305,216	450,372	755,588	8.38
2.換匯(Fx Swaps)	3,166,142	2,348,966	5,515,108	61.14
3.換匯換利(Currency Swaps)	53,202	1,801	55,003	0.61
4.買入選擇權(Bought Options)	28,638	1,032,315	1,060,953	11.76
5.賣出選擇權(Sold Options)	28,271	1,044,672	1,072,943	11.90
(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)	182,098	8,601	190,699	2.11
(一)店頭市場(OTC)	387	3,466	3,853	0.04
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	181,711	5,135	186,846	2.07
四、商品有關契約 (Commodity Contracts)	1,296	19,380	20,676	0.23
(一)店頭市場(OTC)	-	16,260	16,260	0.18
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	1,296	3,120	4,416	0.05
小 計(一至四)	3,823,951	5,194,760	9,018,711	99.98
五、信用有關契約 (Credit Contracts)	-	1,404	1,404	0.02
1.信用違約交換(Credit Default Swap)	-	1,404	1,404	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	3,823,951	5,196,164	9,020,115	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	102年2月		102年1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)	347,741	3.85	704,021	5.62	-356,280	-50.61
(一)店頭市場(OTC)	109,792	1.21	349,532	2.79	-239,740	-68.59
1.遠期利率協議(FRA)	-	-	771	0.01	-771	-100.00
2.換利(IRS)	101,104	1.12	318,782	2.55	-217,678	-68.28
3.買入選擇權(Bought Options)	1,022	0.01	9,266	0.07	-8,244	-88.97
4.賣出選擇權(Sold Options)	7,666	0.08	20,713	0.16	-13,047	-62.99
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	237,949	2.64	354,489	2.83	-116,540	-32.88
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	115,582	1.28	174,304	1.39	-58,722	-33.69
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	122,367	1.36	179,623	1.43	-57,256	-31.88
3.買入選擇權(Bought Options)	-	-	-	-	-	-
4.賣出選擇權(Sold Options)	-	-	562	0.01	-562	-100.00
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	8,459,595	93.79	11,373,881	90.82	-2,914,286	-25.62
(一)店頭市場(OTC)	8,459,595	93.79	11,373,881	90.82	-2,914,286	-25.62
1.遠期契約(Outright Forwards) ²	755,588	8.38	1,137,732	9.09	-382,144	-33.59
2.換匯(Fx Swaps)	5,515,108	61.14	7,161,567	57.18	-1,646,459	-22.99
3.換匯換利(Currency Swaps)	55,003	0.61	76,944	0.62	-21,941	-28.52
4.買入選擇權(Bought Options)	1,060,953	11.76	1,492,116	11.91	-431,163	-28.90
5.賣出選擇權(Sold Options)	1,072,943	11.90	1,505,522	12.02	-432,579	-28.73
(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)	190,699	2.11	406,069	3.24	-215,370	-53.04
(一)店頭市場(OTC)	3,853	0.04	12,133	0.10	-8,280	-68.24
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	186,846	2.07	393,936	3.14	-207,090	-52.57
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	20,676	0.23	28,463	0.23	-7,787	-27.36
(一)店頭市場(OTC)	16,260	0.18	21,192	0.17	-4,932	-23.27
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	4,416	0.05	7,271	0.06	-2,855	-39.27
小 計(一至四)	9,018,711	99.98	12,512,434	99.91	-3,493,723	-27.92
五、信用有關契約(Credit Contracts)	1,404	0.02	11,522	0.09	-10,118	-87.81
1.信用違約交換(Credit Default Swap)	1,404	0.02	11,522	0.09	-10,118	-87.81
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	9,020,115	100.00	12,523,956	100.00	-3,503,841	-27.98

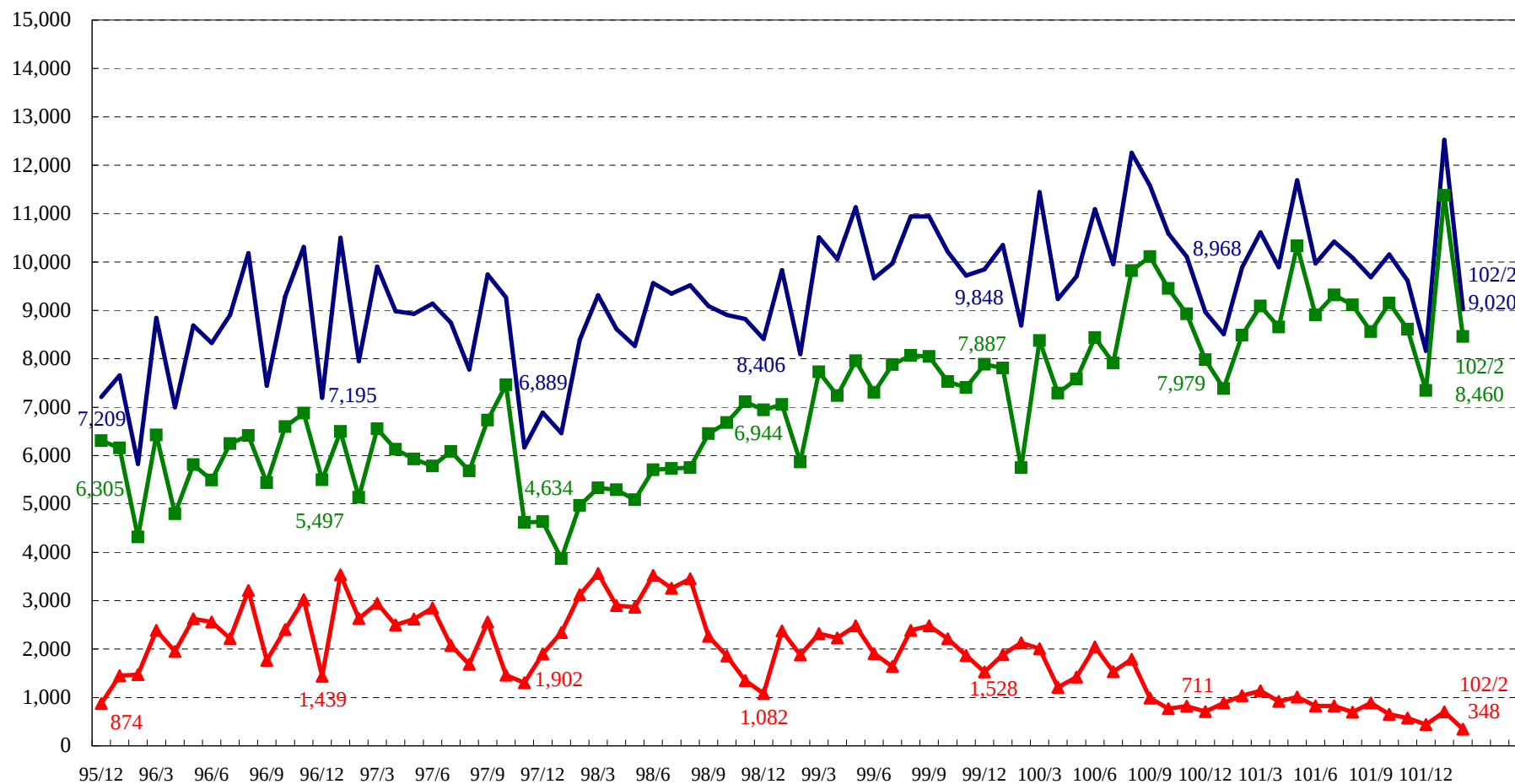
註：1. 包括國內總分支機構及國際金融業務分行資料，不含海外分行及子行；本表已剔除銀行間交易重複計算部分。

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2月銀行辦理衍生性金融商品交易量統計

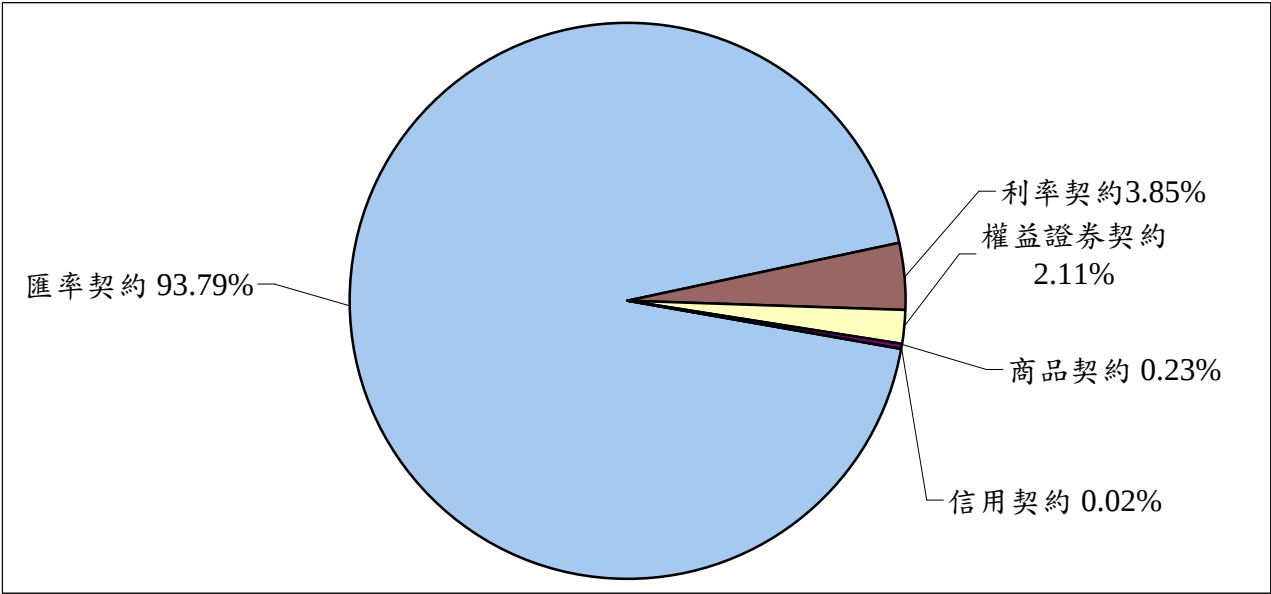
新臺幣十億元

— 總交易量 ■ 匯率有關契約 ▲ 利率有關契約

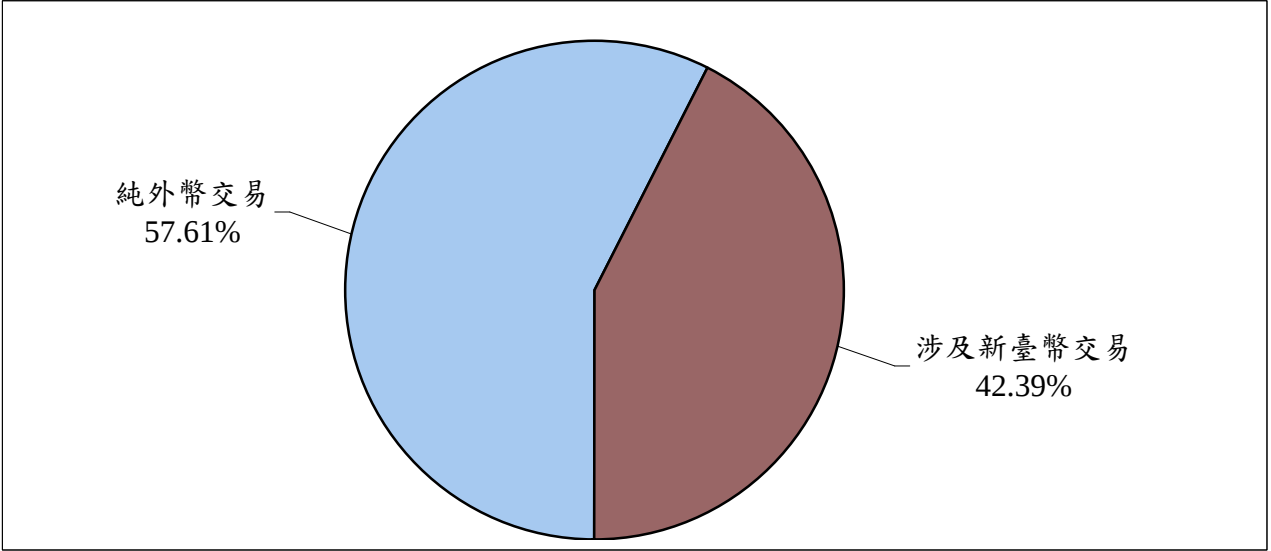


附圖2 102年2月銀行衍生性金融商品交易量內容分析

商品種類別



幣別



銀行類別

