

附表1 銀行衍生性金融商品交易量彙總表

102年9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)	126,380	421,386	547,766	4.70
(一)店頭市場(OTC)	126,380	52,055	178,435	1.53
1.遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-
2.換利(IRS)	124,054	48,536	172,590	1.48
3.買入選擇權(Bought Options)	269	-	269	-
4.賣出選擇權(Sold Options)	2,057	3,519	5,576	0.05
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	369,331	369,331	3.17
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	-	179,104	179,104	1.54
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	-	190,227	190,227	1.63
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)	4,173,116	6,554,794	10,727,910	92.03
(一)店頭市場(OTC)	4,173,116	6,554,794	10,727,910	92.03
1.遠期契約(Outright Forwards) ²	342,155	598,730	940,885	8.07
2.換匯(Fx Swaps)	3,712,980	2,891,337	6,604,317	56.66
3.換匯換利(Currency Swaps)	48,162	4,831	52,993	0.45
4.買入選擇權(Bought Options)	34,789	1,523,685	1,558,474	13.37
5.賣出選擇權(Sold Options)	35,030	1,536,211	1,571,241	13.48
(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)	349,508	9,498	359,006	3.08
(一)店頭市場(OTC)	28	3,002	3,030	0.03
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	349,480	6,496	355,976	3.05
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	1,332	18,431	19,763	0.17
(一)店頭市場(OTC)	-	9,657	9,657	0.08
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	1,332	8,774	10,106	0.09
小 計(一至四)	4,650,336	7,004,109	11,654,445	99.98
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	1,902	1,902	0.02
1.信用違約交換(Credit Default Swap)	-	1,902	1,902	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	4,650,336	7,006,011	11,656,347	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9月		102年8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)	547,766	4.70	619,494	4.88	-71,728	-11.58
(一)店頭市場(OTC)	178,435	1.53	202,028	1.59	-23,593	-11.68
1. 遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-	-	-
2. 換利(IRS)	172,590	1.48	189,088	1.49	-16,498	-8.73
3. 買入選擇權(Bought Options)	269	-	2,147	0.02	-1,878	-87.49
4. 賣出選擇權(Sold Options)	5,576	0.05	10,793	0.08	-5,217	-48.34
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	369,331	3.17	417,466	3.29	-48,135	-11.53
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	179,104	1.54	200,523	1.58	-21,419	-10.68
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	190,227	1.63	216,943	1.71	-26,716	-12.31
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)	10,727,910	92.03	11,689,761	92.08	-961,851	-8.23
(一)店頭市場(OTC)	10,727,910	92.03	11,689,761	92.08	-961,851	-8.23
1. 遠期契約(Outright Forwards) ²	940,885	8.07	943,544	7.43	-2,659	-0.28
2. 換匯(Fx Swaps)	6,604,317	56.66	7,800,753	61.44	-1,196,436	-15.34
3. 換匯換利(Currency Swaps)	52,993	0.45	75,579	0.60	-22,586	-29.88
4. 買入選擇權(Bought Options)	1,558,474	13.37	1,425,209	11.23	133,265	9.35
5. 賣出選擇權(Sold Options)	1,571,241	13.48	1,444,676	11.38	126,565	8.76
(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)	359,006	3.08	352,007	2.77	6,999	1.99
(一)店頭市場(OTC)	3,030	0.03	5,771	0.04	-2,741	-47.50
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	355,976	3.05	346,236	2.73	9,740	2.81
四、商品有關契約 (Commodity Contracts)	19,763	0.17	32,488	0.26	-12,725	-39.17
(一)店頭市場(OTC)	9,657	0.08	12,113	0.10	-2,456	-20.28
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	10,106	0.09	20,375	0.16	-10,269	-50.40
小 計(一至四)	11,654,445	99.98	12,693,750	99.99	-1,039,305	-8.19
五、信用有關契約 (Credit Contracts)	1,902	0.02	1,681	0.01	221	13.15
1. 信用違約交換(Credit Default Swap)	1,902	0.02	1,681	0.01	221	13.15
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	11,656,347	100.00	12,695,431	100.00	-1,039,084	-8.18

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。

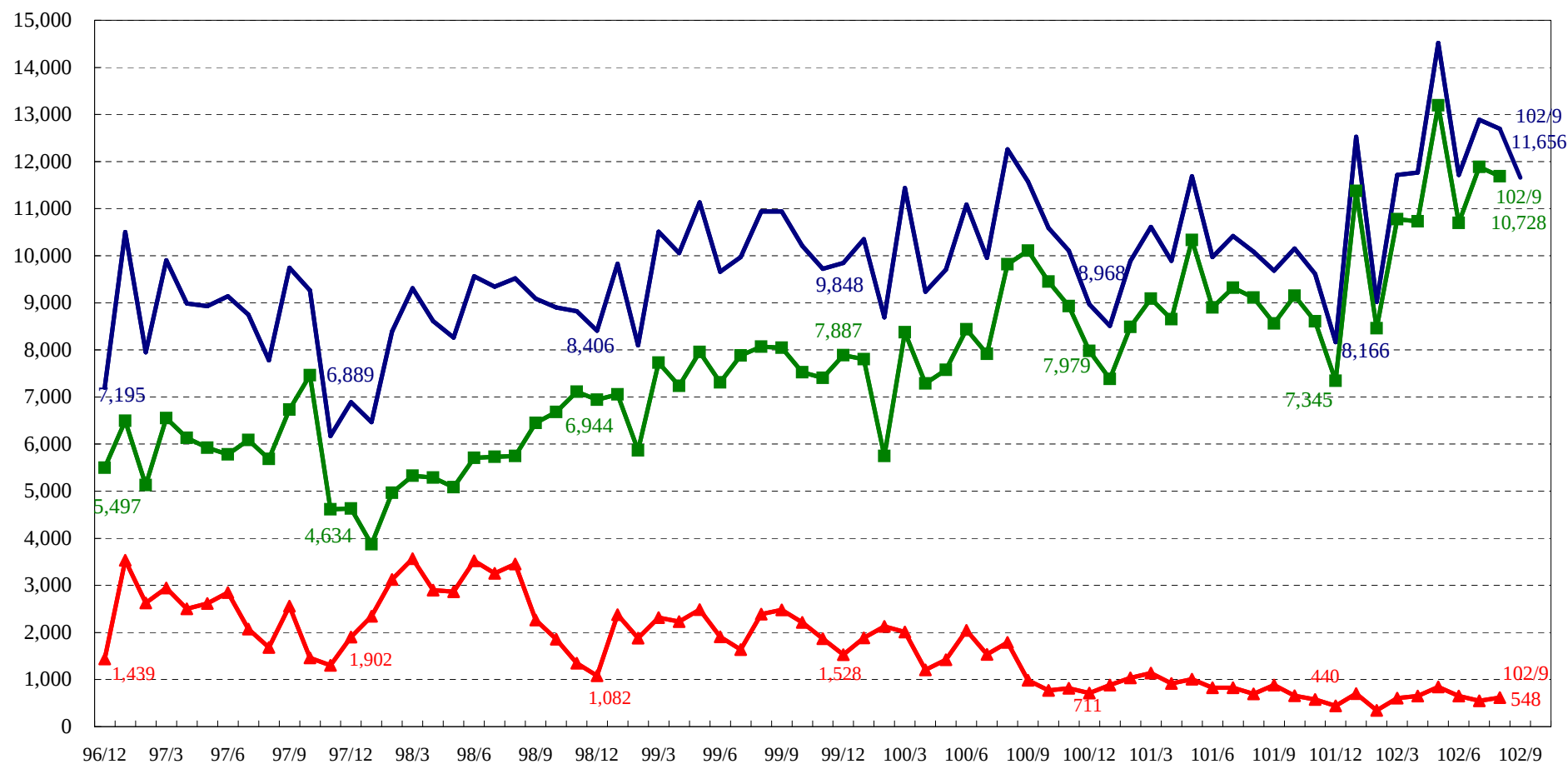
附圖1 102年9月銀行辦理衍生性金融商品交易量統計

新臺幣十億元

— 總交易量

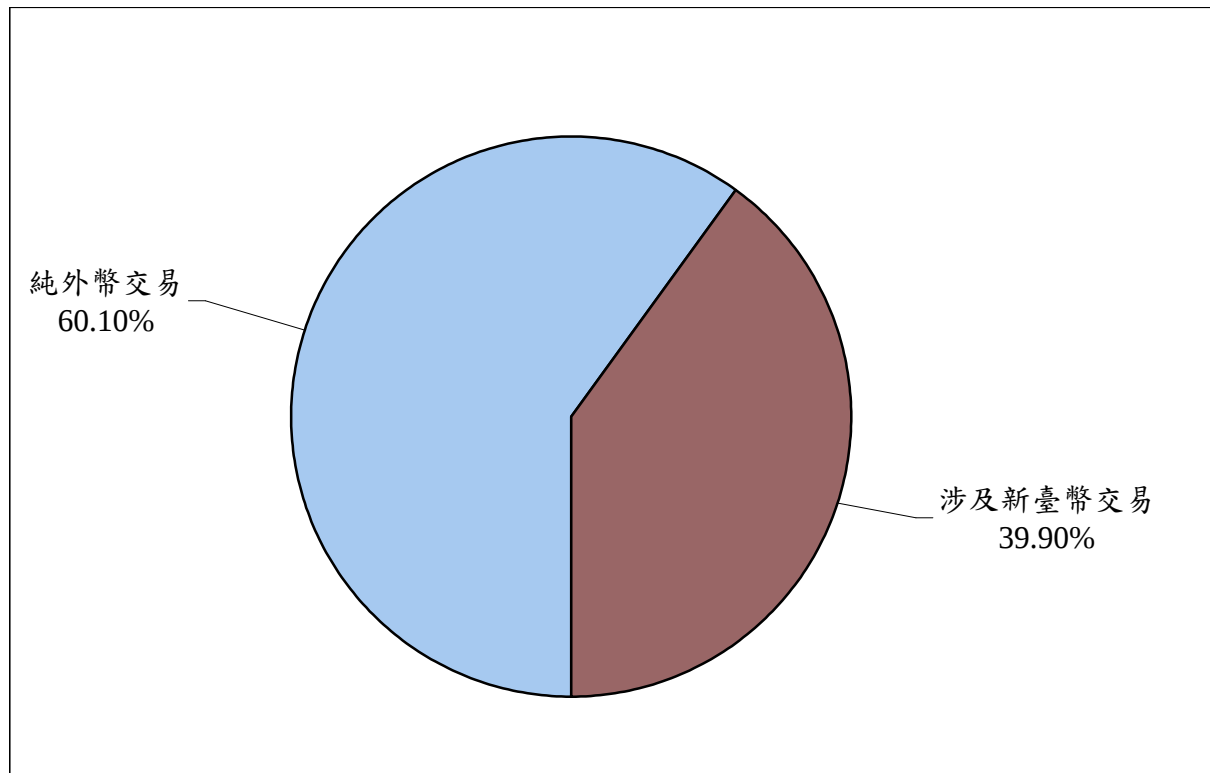
■ 匯率有關契約

▲ 利率有關契約



附圖2 102年9月銀行衍生性金融商品交易量內容分析

幣別



銀行類別

