

# 附表1 銀行衍生性金融商品交易量彙總表

103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 <sup>1</sup>			
	涉及新臺幣交易	純外幣交易	合 計	比重
<b>一、利率有關契約(Interest Rate Contracts)</b>	<b>98,441</b>	<b>573,897</b>	<b>672,338</b>	<b>4.63</b>
(一)店頭市場(OTC)	98,441	65,453	163,894	1.13
1.遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-
2.換利(IRS)	92,993	64,156	157,149	1.08
3.買入選擇權(Bought Options)	1,091	-	1,091	0.01
4.賣出選擇權(Sold Options)	4,357	1,297	5,654	0.04
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	508,444	508,444	3.50
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	-	216,969	216,969	1.49
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	-	224,114	224,114	1.54
3.買入選擇權(Bought Options)	-	24,349	24,349	0.17
4.賣出選擇權(Sold Options)	-	43,012	43,012	0.30
<b>二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)</b>	<b>5,371,387</b>	<b>7,995,934</b>	<b>13,367,321</b>	<b>91.96</b>
(一)店頭市場(OTC)	5,371,387	7,995,934	13,367,321	91.96
1.遠期契約(Outright Forwards) <sup>2</sup>	278,092	908,544	1,186,636	8.16
2.換匯(Fx Swaps)	4,935,143	3,980,450	8,915,593	61.34
3.換匯換利(Currency Swaps)	94,175	7,990	102,165	0.70
4.買入選擇權(Bought Options)	34,262	1,564,259	1,598,521	11.00
5.賣出選擇權(Sold Options)	29,715	1,534,691	1,564,406	10.76
(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)	-	-	-	-
<b>三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)</b>	<b>453,485</b>	<b>14,660</b>	<b>468,145</b>	<b>3.22</b>
(一)店頭市場(OTC)	5,369	278	5,647	0.04
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	448,116	14,382	462,498	3.18
<b>四、商品有關契約(Commodity Contracts)</b>	<b>573</b>	<b>25,776</b>	<b>26,349</b>	<b>0.18</b>
(一)店頭市場(OTC)	-	14,156	14,156	0.10
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	573	11,620	12,193	0.08
<b>小 計(一至四)</b>	<b>5,923,886</b>	<b>8,610,267</b>	<b>14,534,153</b>	<b>99.99</b>
<b>五、信用有關契約(Credit Contracts)</b>	<b>-</b>	<b>1,237</b>	<b>1,237</b>	<b>0.01</b>
1.信用違約交換(Credit Default Swap)	-	1,237	1,237	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)	-	-	-	-
<b>六、其他有關契約(Other Contracts)</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>
1.遠期契約(Outright Forwards)	-	-	-	-
2.交換(Swaps)	-	-	-	-
3.選擇權(Options)	-	-	-	-
<b>總 計</b>	<b>5,923,886</b>	<b>8,611,504</b>	<b>14,535,390</b>	<b>100.00</b>

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；%

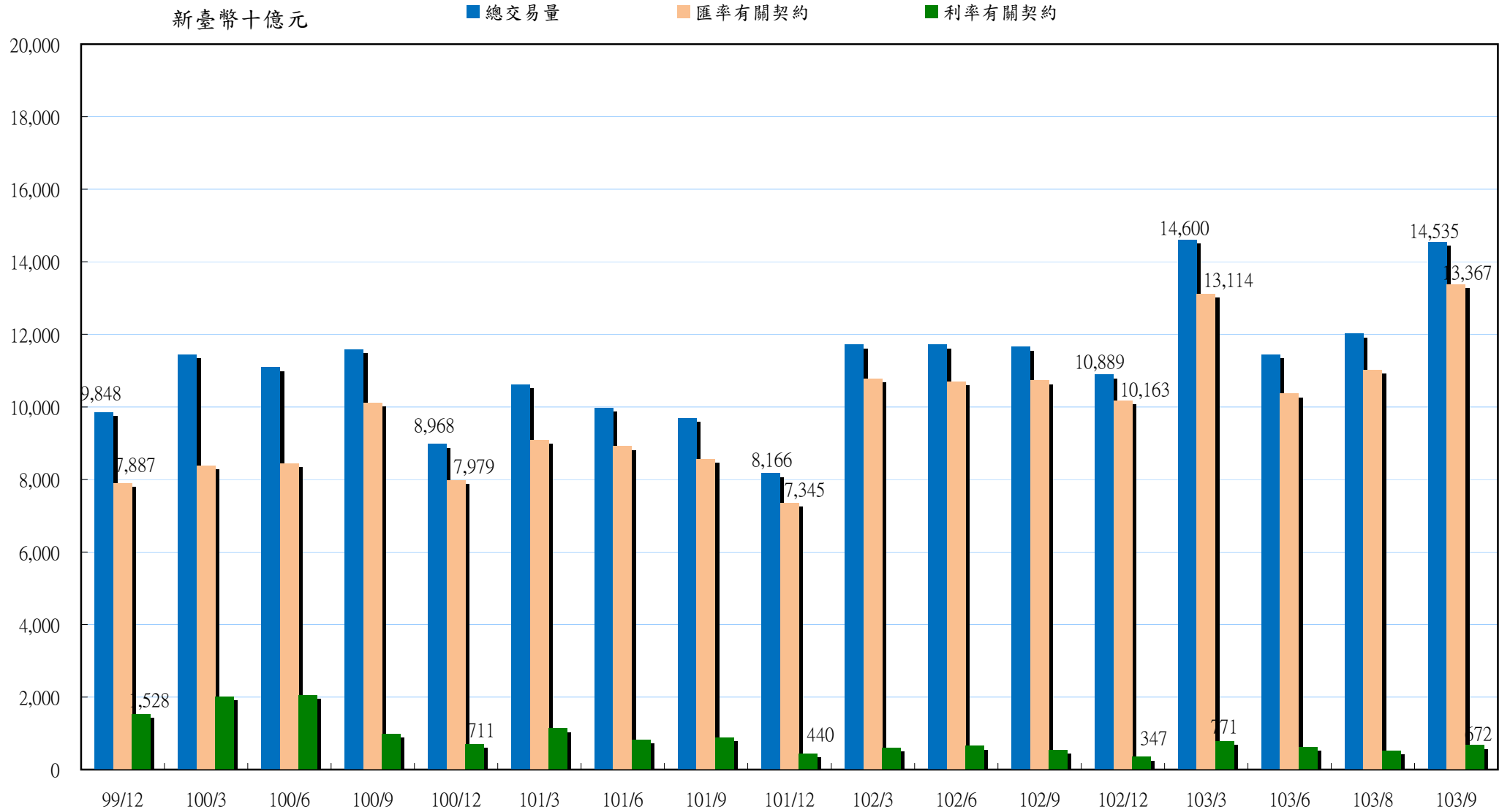
商品種類	103年9月		103年8月		比較增減	
	合計 <sup>1</sup>	比重	合計	比重	差額	變動率
<b>一、利率有關契約(Interest Rate Contracts)</b>	672,338	4.63	529,477	4.41	142,861	26.98
(一)店頭市場(OTC)	163,894	1.13	184,380	1.54	-20,486	-11.11
1. 遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-	-	-
2. 換利(IRS)	157,149	1.08	158,143	1.32	-994	-0.63
3. 買入選擇權(Bought Options)	1,091	0.01	8,547	0.07	-7,456	-87.24
4. 賣出選擇權(Sold Options)	5,654	0.04	17,690	0.15	-12,036	-68.04
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	508,444	3.50	345,097	2.87	163,347	47.33
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	216,969	1.49	143,530	1.19	73,439	51.17
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	224,114	1.54	149,532	1.24	74,582	49.88
3. 買入選擇權(Bought Options)	24,349	0.17	28,490	0.24	-4,141	-14.53
4. 賣出選擇權(Sold Options)	43,012	0.30	23,545	0.20	19,467	82.68
<b>二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)</b>	13,367,321	91.96	R 11,016,323	91.70	2,350,998	21.34
(一)店頭市場(OTC)	13,367,321	91.96	R 11,016,323	91.70	2,350,998	21.34
1. 遠期契約(Outright Forwards) <sup>2</sup>	1,186,636	8.16	848,455	7.06	338,182	39.86
2. 換匯(Fx Swaps)	8,915,593	61.34	R 7,414,026	61.72	1,501,567	20.25
3. 換匯換利(Currency Swaps)	102,165	0.70	94,198	0.78	7,967	8.46
4. 買入選擇權(Bought Options)	1,598,521	11.00	1,332,094	11.09	266,428	20.00
5. 賣出選擇權(Sold Options)	1,564,406	10.76	1,327,550	11.05	236,857	17.84
(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)	-	-	-	-	-	-
<b>三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)</b>	468,145	3.22	441,645	3.68	26,500	6.00
(一)店頭市場(OTC)	5,647	0.04	577	0.01	5,071	879.53
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	462,498	3.18	441,068	3.67	21,431	4.86
<b>四、商品有關契約(Commodity Contracts)</b>	26,349	0.18	20,384	0.17	5,965	29.26
(一)店頭市場(OTC)	14,156	0.10	11,840	0.10	2,316	19.56
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	12,193	0.08	8,544	0.07	3,649	42.71
<b>小計(一至四)</b>	14,534,153	99.99	R 12,007,829	99.96	2,526,324	21.04
<b>五、信用有關契約(Credit Contracts)</b>	1,237	0.01	5,361	0.04	-4,124	-76.93
1. 信用違約交換(Credit Default Swap)	1,237	0.01	5,361	0.04	-4,124	-76.93
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)	-	-	-	-	-	-
<b>六、其他有關契約(Other Contracts)</b>	-	-	-	-	-	-
1. 遠期契約(Outright Forwards)	-	-	-	-	-	-
2. 交換(Swaps)	-	-	-	-	-	-
3. 選擇權(Options)	-	-	-	-	-	-
<b>總計</b>	14,535,390	100.00	R 12,013,190	100.00	2,522,200	21.00

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。

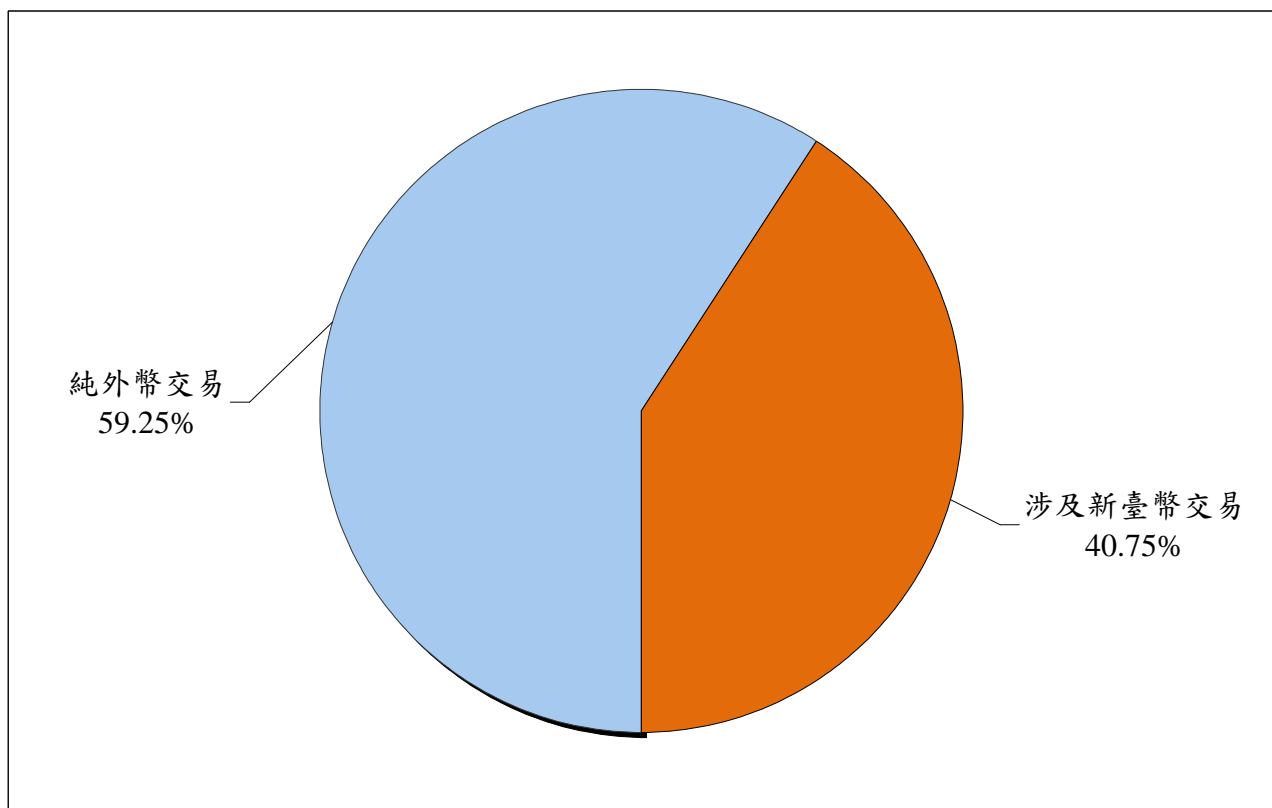
3. R為修正後數字。

# 附圖1 銀行辦理衍生性金融商品交易量統計



附圖2 103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

