

附表1 銀行衍生性金融商品交易量彙總表

103年4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)	89,261	516,133	605,394	4.33
(一)店頭市場(OTC)	89,261	64,187	153,448	1.10
1.遠期利率協議(FRA)	7,238	657	7,895	0.06
2.換利(IRS)	77,891	60,828	138,719	0.99
3.買入選擇權(Bought Options)	1,343	877	2,220	0.02
4.賣出選擇權(Sold Options)	2,789	1,825	4,614	0.03
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	451,946	451,946	3.23
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	-	212,962	212,962	1.52
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	-	219,317	219,317	1.57
3.買入選擇權(Bought Options)	-	7,564	7,564	0.05
4.賣出選擇權(Sold Options)	-	12,103	12,103	0.09
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	5,636,674	7,042,902	12,679,576	90.74
(一)店頭市場(OTC)	5,636,674	7,042,902	12,679,576	90.74
1.遠期契約(Outright Forwards) ²	322,416	781,423	1,103,839	7.90
2.換匯(Fx Swaps)	5,185,555	4,148,359	9,333,914	66.80
3.換匯換利(Currency Swaps)	61,739	10,724	72,463	0.52
4.買入選擇權(Bought Options)	34,739	1,030,827	1,065,566	7.62
5.賣出選擇權(Sold Options)	32,225	1,071,569	1,103,794	7.90
(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)	631,715	8,328	640,043	4.58
(一)店頭市場(OTC)	1,984	616	2,600	0.02
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	629,731	7,712	637,443	4.56
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	709	43,521	44,230	0.32
(一)店頭市場(OTC)	-	8,077	8,077	0.06
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	709	35,444	36,153	0.26
小 計(一至四)	6,358,359	7,610,884	13,969,243	99.97
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	4,022	4,022	0.03
1.信用違約交換(Credit Default Swap)	-	2,094	2,094	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)	-	1,928	1,928	0.01
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	6,358,359	7,614,906	13,973,265	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

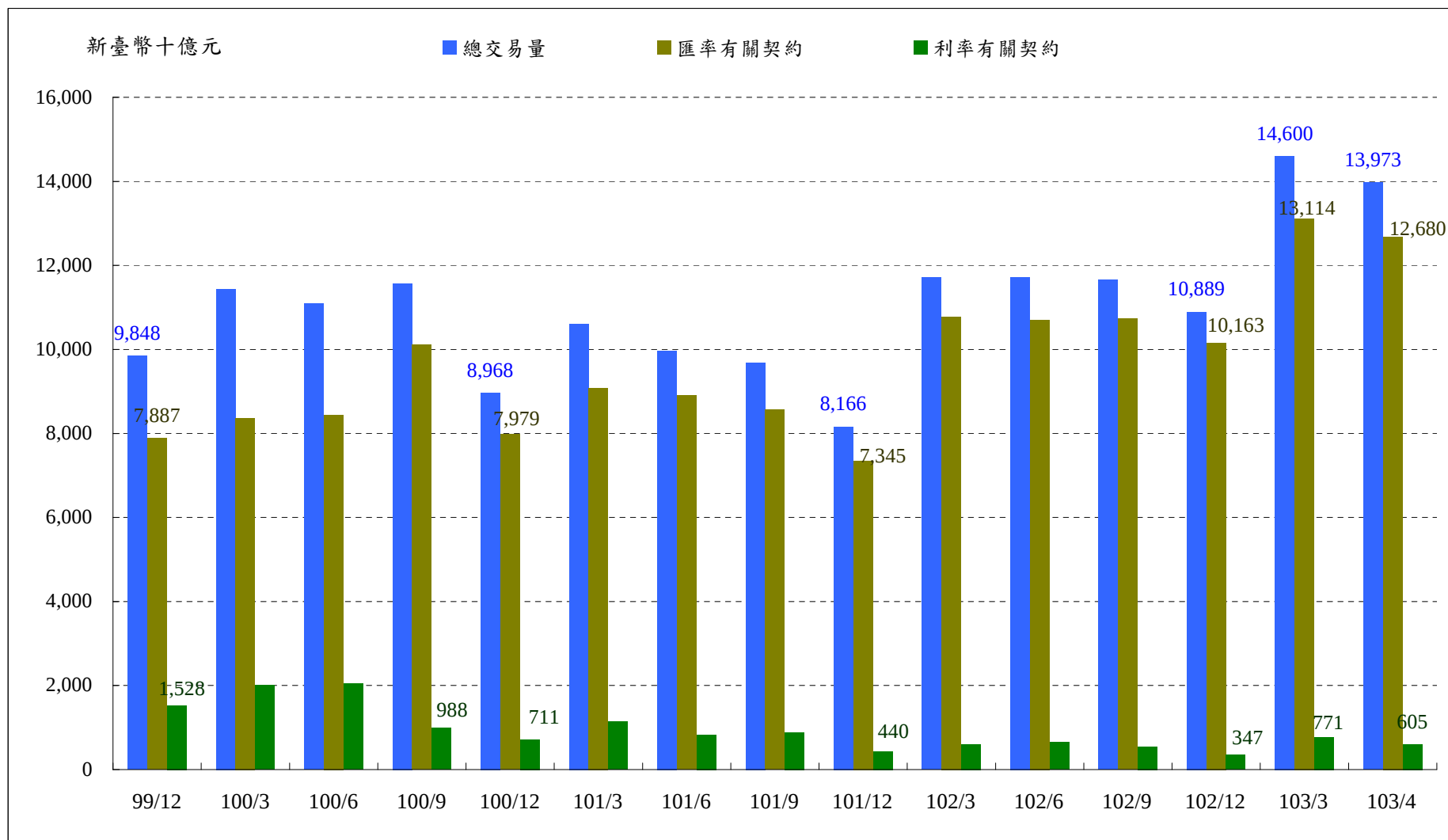
單位：新臺幣百萬元；%

商 品 種 類	103年4月		103年3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)	605,394	4.33	771,179	5.29	-165,785	-21.50
(一)店頭市場(OTC)	153,448	1.10	161,236	1.11	-7,788	-4.83
1. 遠期利率協議(FRA)	7,895	0.06	-	-	-	-
2. 換利(IRS)	138,719	0.99	151,200	1.04	-12,481	-8.25
3. 買入選擇權(Bought Options)	2,220	0.02	1,187	0.01	1,033	87.03
4. 賣出選擇權(Sold Options)	4,614	0.03	8,849	0.06	-4,235	-47.86
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	451,946	3.23	609,943	4.18	-157,997	-25.90
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	212,962	1.52	286,135	1.96	-73,173	-25.57
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	219,317	1.57	323,808	2.22	-104,491	-32.27
3. 買入選擇權(Bought Options)	7,564	0.05	-	-	-	-
4. 賣出選擇權(Sold Options)	12,103	0.09	-	-	-	-
二、匯率有關契約 (Foreign Exchange Transactions)	12,679,576	90.74	13,114,019	89.82	-434,443	-3.31
(一)店頭市場(OTC)	12,679,576	90.74	13,114,019	89.82	-434,443	-3.31
1. 遠期契約(Outright Forwards) ²	1,103,839	7.90	1,125,843	7.71	-22,004	-1.95
2. 換匯(Fx Swaps)	9,333,914	66.80	9,161,336	62.75	172,578	1.88
3. 換匯換利(Currency Swaps)	72,463	0.52	106,321	0.73	-33,858	-31.85
4. 買入選擇權(Bought Options)	1,065,566	7.62	1,320,681	9.04	-255,115	-19.32
5. 賣出選擇權(Sold Options)	1,103,794	7.90	1,399,838	9.59	-296,044	-21.15
(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)	640,043	4.58	580,565	3.98	59,478	10.24
(一)店頭市場(OTC)	2,600	0.02	4,300	0.03	-1,700	-39.53
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	637,443	4.56	576,265	3.95	61,178	10.62
四、商品有關契約 (Commodity Contracts)	44,230	0.32	131,252	0.89	-87,022	-66.30
(一)店頭市場(OTC)	8,077	0.06	9,442	0.06	-1,365	-14.46
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	36,153	0.26	121,810	0.83	-85,657	-70.32
小 計(一至四)	13,969,243	99.97	14,597,015	99.98	-627,772	-4.30
五、信用有關契約 (Credit Contracts)	4,022	0.03	2,930	0.02	1,092	37.27
1. 信用違約交換(Credit Default Swap)	2,094	0.02	2,930	0.02	-836	-28.53
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)	1,928	0.01	-	-	1,928	0.01
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	13,973,265	100.00	14,599,945	100.00	-626,680	-4.29

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。

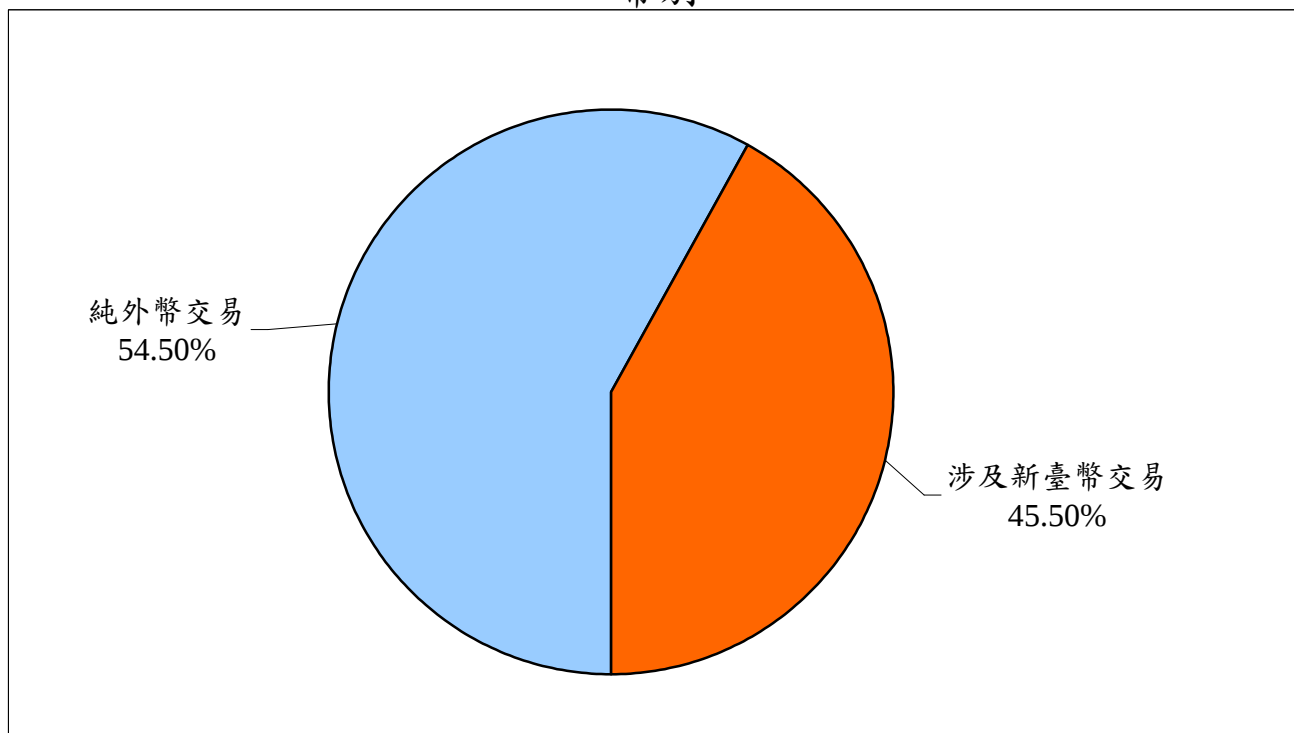
2. 「匯率有關—遠期契約」中「涉及新臺幣交易」金額包括新臺幣對外幣無本金交割遠期外匯交易；「純外幣交易」金額包括外幣保證金交易以遠期契約承作者。

附圖1 銀行辦理衍生性金融商品交易量統計



附圖2 103年4月銀行衍生性金融商品交易量內容分析

幣別



銀行類別

