

附表1 銀行衍生性金融商品交易量彙總表

102年5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)	197,099	644,225	841,324	5.79
(一)店頭市場(OTC)	197,099	85,206	282,305	1.94
1.遠期利率協議(FRA)	518	150	668	-
2.換利(IRS)	187,155	69,105	256,260	1.76
3.買入選擇權(Bought Options)	3,614	34	3,648	0.03
4.賣出選擇權(Sold Options)	5,812	15,917	21,729	0.15
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	559,019	559,019	3.85
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	-	287,908	287,908	1.98
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	-	271,111	271,111	1.87
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)	4,745,595	8,446,876	13,192,471	90.85
(一)店頭市場(OTC)	4,745,595	8,446,876	13,192,471	90.85
1.遠期契約(Outright Forwards) ²	420,246	841,498	1,261,744	8.69
2.換匯(Fx Swaps)	4,195,145	4,062,531	8,257,676	56.87
3.換匯換利(Currency Swaps)	47,911	4,562	52,473	0.36
4.買入選擇權(Bought Options)	39,488	1,755,488	1,794,976	12.36
5.賣出選擇權(Sold Options)	42,805	1,782,797	1,825,602	12.57
(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)	432,303	15,908	448,211	3.09
(一)店頭市場(OTC)	905	1,565	2,470	0.02
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	431,398	14,343	445,741	3.07
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	1,690	32,706	34,396	0.24
(一)店頭市場(OTC)	-	14,167	14,167	0.10
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	1,690	18,539	20,229	0.14
小 計(一至四)	5,376,687	9,139,715	14,516,402	99.97
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	4,515	4,515	0.03
1.信用違約交換(Credit Default Swap)	-	4,515	4,515	0.03
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	5,376,687	9,144,230	14,520,917	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，%

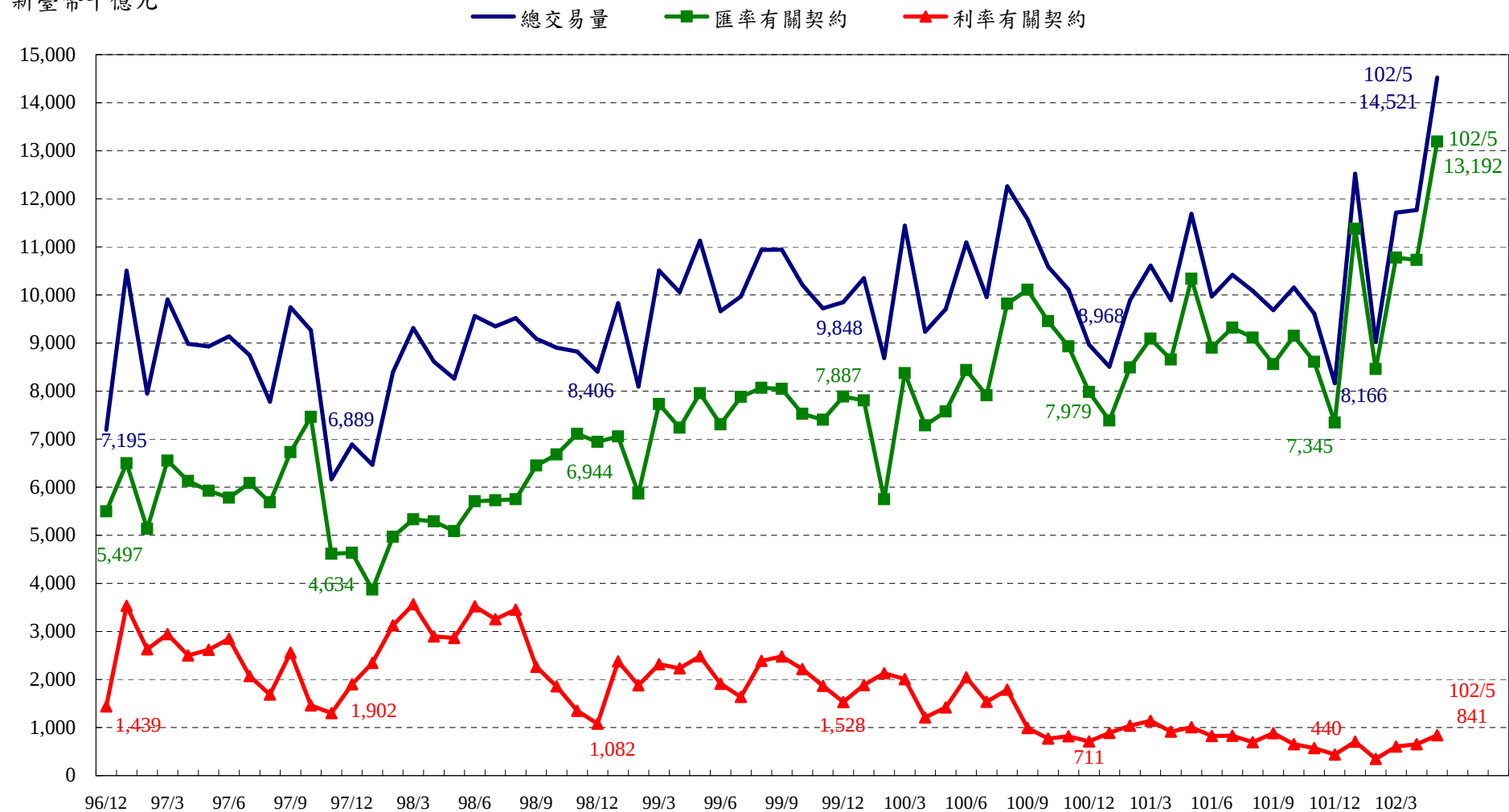
商 品 種 類	102年5月		102年4月		比較增減	
	合 計 ¹	比重	合 計	比重	合 計	變動率
一、利率有關契約(Interest Rate Contracts)	841,324	5.79	652,393	5.54	188,931	28.96
(一)店頭市場(OTC)	282,305	1.94	229,388	1.95	52,917	23.07
1. 遠期利率協議(FRA)	668	-	-	-	668	-
2. 換利(IRS)	256,260	1.76	209,170	1.78	47,090	22.51
3. 買入選擇權(Bought Options)	3,648	0.03	8,944	0.08	-5,296	-59.21
4. 賣出選擇權(Sold Options)	21,729	0.15	11,274	0.09	10,455	92.74
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	559,019	3.85	423,005	3.59	136,014	32.15
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	287,908	1.98	199,206	1.69	88,702	44.53
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	271,111	1.87	223,799	1.90	47,312	21.14
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)	13,192,471	90.85	10,728,918	91.17	2,463,553	22.96
(一)店頭市場(OTC)	13,192,471	90.85	10,728,918	91.17	2,463,553	22.96
1. 遠期契約(Outright Forwards) ²	1,261,744	8.69	1,045,635	8.89	216,109	20.67
2. 換匯(Fx Swaps)	8,257,676	56.87	6,910,598	58.72	1,347,078	19.49
3. 換匯換利(Currency Swaps)	52,473	0.36	147,977	1.26	-95,504	-64.54
4. 買入選擇權(Bought Options)	1,794,976	12.36	1,321,381	11.23	473,595	35.84
5. 賣出選擇權(Sold Options)	1,825,602	12.57	1,303,327	11.07	522,275	40.07
(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)	448,211	3.09	353,197	3.00	95,014	26.90
(一)店頭市場(OTC)	2,470	0.02	5,192	0.04	-2,722	-52.43
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	445,741	3.07	348,005	2.96	97,736	28.08
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	34,396	0.24	31,411	0.27	2,985	9.50
(一)店頭市場(OTC)	14,167	0.10	15,028	0.13	-861	-5.73
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	20,229	0.14	16,383	0.14	3,846	23.48
小 計(一至四)	14,516,402	99.97	11,765,919	99.98	2,750,483	23.38
五、信用有關契約(Credit Contracts)	4,515	0.03	2,642	0.02	1,873	70.89
1. 信用違約交換(Credit Default Swap)	4,515	0.03	2,642	0.02	1,873	70.89
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	14,520,917	100.00	11,768,561	100.00	2,752,356	23.39

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。

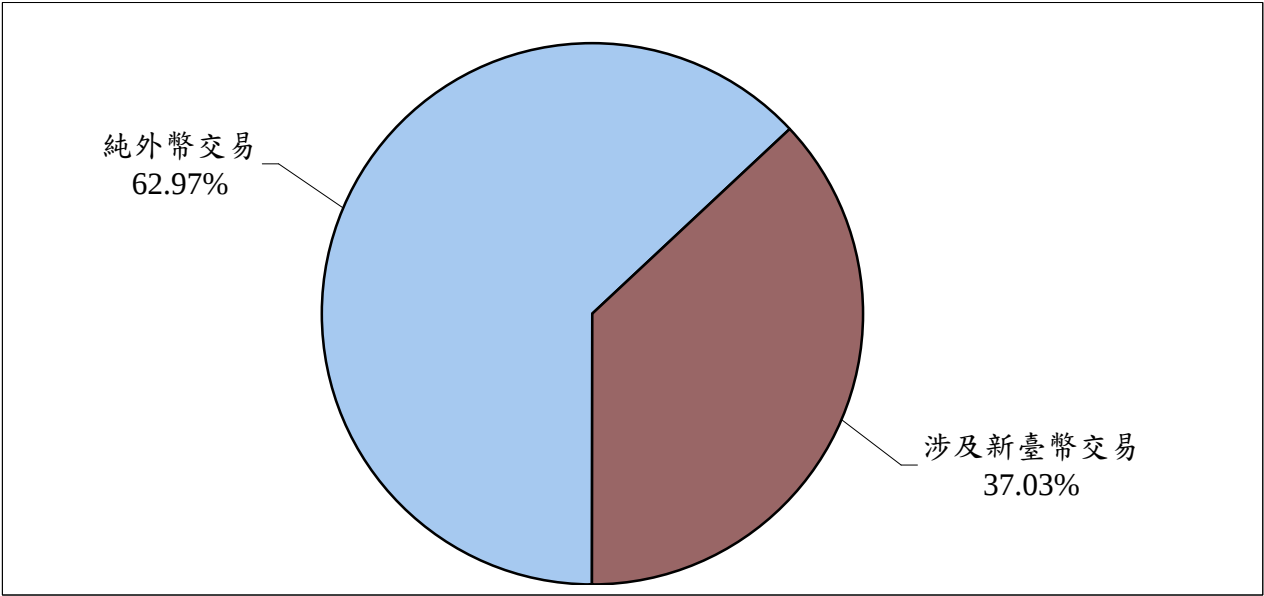
附圖1 102年5月銀行辦理衍生性金融商品交易量統計

新臺幣十億元



附圖2 102年5月銀行衍生性金融商品交易量內容分析

幣別



銀行類別

