

附表1 銀行衍生性金融商品交易量彙總表

103年12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)	58,680	230,171	288,851	2.18
(一)店頭市場(OTC)	58,680	79,076	137,756	1.04
1.遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-
2.換利(IRS)	56,143	74,025	130,168	0.98
3.買入選擇權(Bought Options)	680	6	686	0.01
4.賣出選擇權(Sold Options)	1,857	5,045	6,902	0.05
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	151,095	151,095	1.14
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	-	64,612	64,612	0.49
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	-	86,483	86,483	0.65
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)	5,121,577	7,362,043	12,483,620	94.29
(一)店頭市場(OTC)	5,121,577	7,362,043	12,483,620	94.29
1.遠期契約(Outright Forwards) ²	227,495	1,039,726	1,267,221	9.57
2.換匯(Fx Swaps)	4,719,979	4,186,049	8,906,028	67.27
3.換匯換利(Currency Swaps)	121,720	2,355	124,075	0.94
4.買入選擇權(Bought Options)	25,799	1,097,894	1,123,693	8.49
5.賣出選擇權(Sold Options)	26,584	1,036,019	1,062,603	8.02
(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)	439,873	9,094	448,967	3.39
(一)店頭市場(OTC)	266	60	326	-
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	439,607	9,034	448,641	3.39
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	1,079	12,947	14,026	0.11
(一)店頭市場(OTC)	-	5,371	5,371	0.04
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	1,079	7,576	8,655	0.07
小 計(一至四)	5,621,209	7,614,255	13,235,464	99.97
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	4,208	4,208	0.03
1.信用違約交換(Credit Default Swap)	-	4,208	4,208	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	5,621,209	7,618,463	13,239,672	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12月		103年11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)	288,851	2.18	441,537	3.44	-152,686	-34.58
(一)店頭市場(OTC)	137,756	1.04	183,743	1.43	-45,987	-25.03
1. 遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-	-	-
2. 換利(IRS)	130,168	0.98	172,815	1.35	-42,647	-24.68
3. 買入選擇權(Bought Options)	686	0.01	730	-	-44	-6.03
4. 賣出選擇權(Sold Options)	6,902	0.05	10,198	0.08	-3,296	-32.32
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	151,095	1.14	257,794	2.01	-106,699	-41.39
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	64,612	0.49	115,685	0.90	-51,073	-44.15
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	86,483	0.65	113,553	0.89	-27,070	-23.84
3. 買入選擇權(Bought Options)	-	-	14,278	0.11	-14,278	-100.00
4. 賣出選擇權(Sold Options)	-	-	14,278	0.11	-14,278	-100.00
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	12,483,620	94.29	12,047,414	93.92	436,206	3.62
(一)店頭市場(OTC)	12,483,620	94.29	12,047,414	93.92	436,206	3.62
1. 遠期契約(Outright Forwards) ²	1,267,221	9.57	1,121,897	8.75	145,324	12.95
2. 換匯(Fx Swaps)	8,906,028	67.27	8,197,274	63.90	708,754	8.65
3. 換匯換利(Currency Swaps)	124,075	0.94	89,117	0.69	34,958	39.23
4. 買入選擇權(Bought Options)	1,123,693	8.49	1,359,164	10.60	-235,471	-17.32
5. 賣出選擇權(Sold Options)	1,062,603	8.02	1,279,962	9.98	-217,359	-16.98
(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)	448,967	3.39	318,595	2.48	130,372	40.92
(一)店頭市場(OTC)	326	-	1,452	0.01	-1,126	-77.55
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	448,641	3.39	317,143	2.47	131,498	41.46
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	14,026	0.11	16,701	0.13	-2,675	-16.02
(一)店頭市場(OTC)	5,371	0.04	6,322	0.05	-951	-15.04
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	8,655	0.07	10,379	0.08	-1,724	-16.61
小 計(一至四)	13,235,464	99.97	12,824,247	99.97	411,217	3.21
五、信用有關契約(Credit Contracts)	4,208	0.03	4,042	0.03	166	4.11
1. 信用違約交換(Credit Default Swap)	4,208	0.03	4,042	0.03	166	4.11
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	13,239,672	100.00	12,828,289	100.00	411,383	3.21

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3 銀行衍生性金融商品交易幣別比較表

單位：新臺幣百萬元；%

商 品 種 類	103年12月		103年11月		比較增減	
	金額	比重	金額	比重	差 額	變動率
涉及新臺幣交易量	5,621,209	42.46	5,154,950	40.18	466,259	9.04
一、利率有關契約(Interest Rate Contracts)	58,680	0.44	22,798	0.18	35,882	157.39
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	5,121,577	38.68	4,821,890	37.59	299,687	6.22
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	439,873	3.33	309,616	2.41	130,257	42.07
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	1,079	0.01	646	-	433	67.03
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	-	-	-	-	-
六、其他有關契約(Other Contracts)	-	-	-	-	-	-
純外幣交易量	7,618,463	57.54	7,673,339	59.82	-54,876	-0.72
一、利率有關契約(Interest Rate Contracts)	230,171	1.74	418,739	3.26	-188,568	-45.03
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	7,362,043	55.60	7,225,524	56.33	136,519	1.89
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	9,094	0.07	8,979	0.07	115	1.28
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	12,947	0.10	16,055	0.13	-3,108	-19.36
五、信用有關契約(Credit Contracts)	4,208	0.03	4,042	0.03	166	4.11
六、其他有關契約(Other Contracts)	-	-	-	-	-	-
總 計	13,239,672	100.00	12,828,289	100.00	411,383	3.21

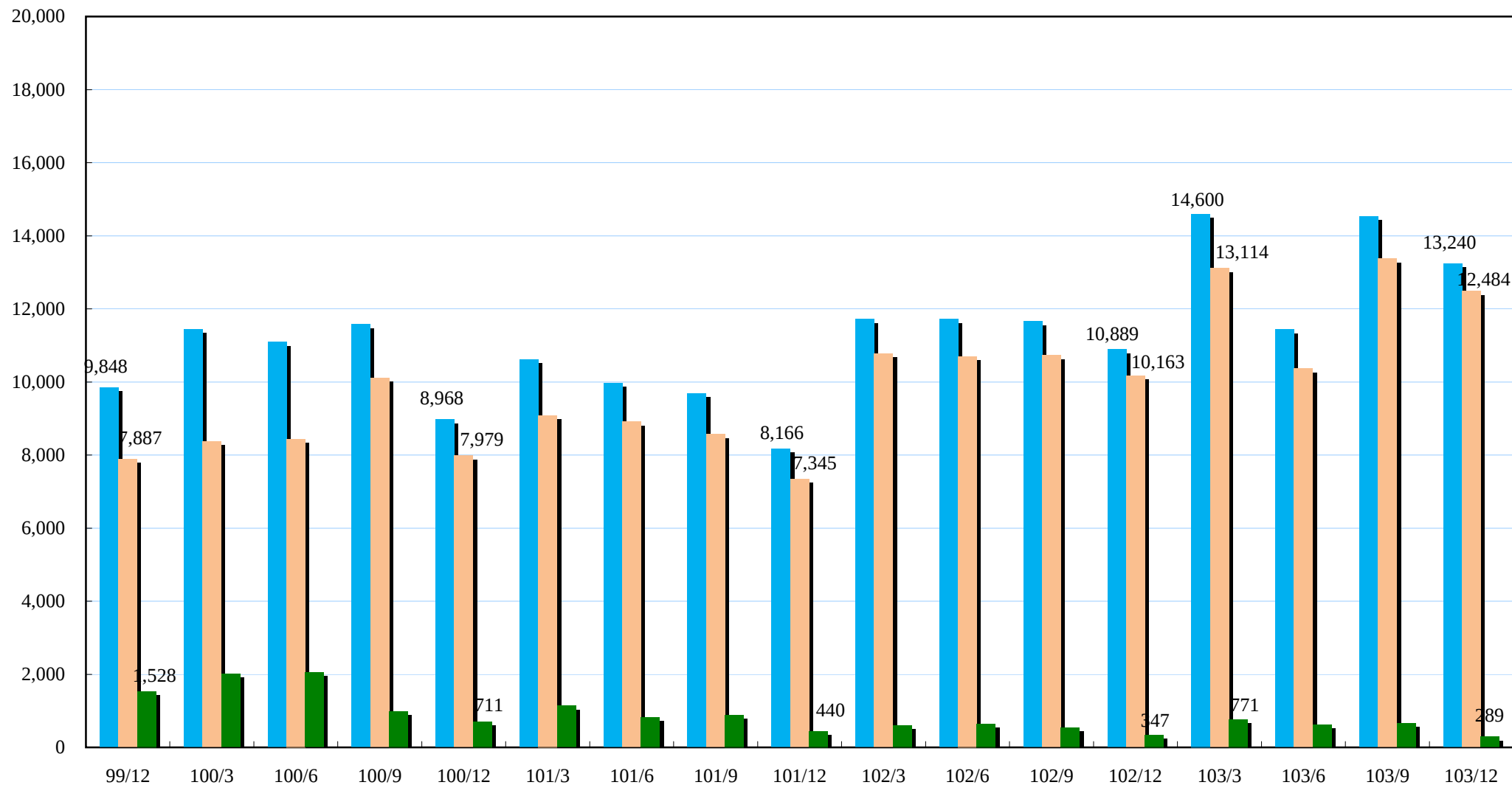
附圖1 銀行辦理衍生性金融商品交易量統計

新臺幣十億元

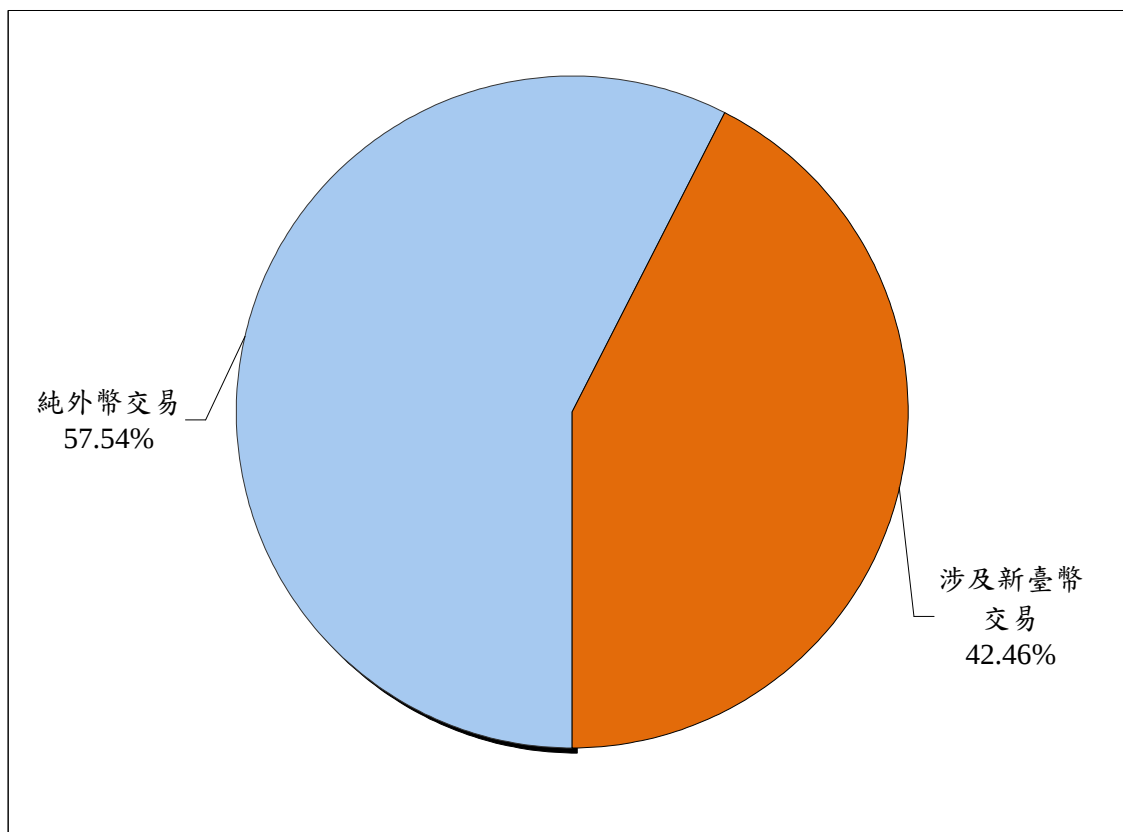
■ 總交易量

■ 匯率有關契約

■ 利率有關契約



附圖2 103年12月銀行衍生性金融商品交易量內容分析
幣別



銀行類別

