

附表1 銀行衍生性金融商品交易量彙總表

101年3月

單位：新臺幣百萬元

商 品 種 類	本國銀行國內總分支機構及外國銀行在台分行			
	涉及新臺幣交易	純外幣交易	合 計	百分比
一、利率有關契約(Interest Rate Contracts)	315,832	821,813	1,137,645	10.72%
(一)店頭市場(OTC)	315,832	269,260	585,092	5.51%
1. 遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-
2. 換利(IRS)	289,650	260,622	550,272	5.18%
3. 買入選擇權(Bought Options)	14,533	615	15,148	0.14%
4. 賣出選擇權(Sold Options)	11,649	8,023	19,672	0.19%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	552,553	552,553	5.21%
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	-	263,104	263,104	2.48%
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	-	289,449	289,449	2.73%
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)	4,193,009	4,895,082	9,088,091	85.64%
(一)店頭市場(OTC)	4,193,009	4,895,082	9,088,091	85.64%
1. 遠期契約(Outright Forwards)	422,322	789,673	1,211,995	11.42%
2. 換匯(Fx Swaps)	3,547,879	2,470,507	6,018,386	56.71%
3. 換匯換利(Currency Swaps)	152,558	8,652	161,210	1.52%
4. 買入選擇權(Bought Options)	37,610	809,660	847,270	7.99%
5. 賣出選擇權(Sold Options)	32,640	816,590	849,230	8.00%
(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)	307,217	20,057	327,274	3.08%
(一)店頭市場(OTC)	1,113	1,195	2,308	0.02%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	306,104	18,862	324,966	3.06%
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	1,496	49,462	50,958	0.48%
(一)店頭市場(OTC)	-	42,916	42,916	0.40%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	1,496	6,546	8,042	0.08%
小 計(一至四)	4,817,554	5,786,414	10,603,968	99.92%
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	8,555	8,555	0.08%
1. 信用違約交換(Credit Default Swap)	-	8,555	8,555	0.08%
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	4,817,554	5,794,969	10,612,523	100.00%

註：1. 本表已剔除銀行間交易重複計算部分。

2. 本國銀行國內總分支機構及外國銀行在台分行係包括國際金融業務分行資料。

3. 「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。

4. 信用有關契約自93年1月份開始統計，其他有關契約自94年1月份開始統計。

附表2 銀行衍生性金融商品交易量比較表

101年3月

單位：新臺幣百萬元

商 品 種 類	101年3月		101年2月		比較增減	
	合 計	百分比	合 計	百分比	合 計	百分比
一、利率有關契約 (Interest Rate Contracts)	1,137,645	10.72%	1,037,556	10.49%	100,089	9.65%
(一)店頭市場(OTC)	585,092	5.51%	599,036	6.06%	-13,944	-2.33%
1.遠期利率協議(FRA)	-	-	11,748	0.12%	-11,748	-100.00%
2.換利(IRS)	550,272	5.18%	562,391	5.69%	-12,119	-2.15%
3.買入選擇權(Bought Options)	15,148	0.14%	11,674	0.12%	3,474	29.76%
4.賣出選擇權(Sold Options)	19,672	0.19%	13,223	0.13%	6,449	48.77%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	552,553	5.21%	438,520	4.43%	114,033	26.00%
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	263,104	2.48%	210,989	2.13%	52,115	24.70%
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	289,449	2.73%	227,531	2.30%	61,918	27.21%
3.買入選擇權(Bought Options)	-	-	-	-	-	0.00%
4.賣出選擇權(Sold Options)	-	-	-	-	-	0.00%
二、匯率有關契約 (Foreign Exchange Transactions)	9,088,091	85.64%	8,487,796	85.84%	600,295	7.07%
(一)店頭市場(OTC)	9,088,091	85.64%	8,487,796	85.84%	600,295	7.07%
1.遠期契約(Outright Forwards)	1,211,995	11.42%	1,096,480	11.09%	115,515	10.54%
2.換匯(Fx Swaps)	6,018,386	56.71%	6,029,833	60.98%	-11,447	-0.19%
3.換匯換利(Currency Swaps)	161,210	1.52%	88,804	0.90%	72,406	81.53%
4.買入選擇權(Bought Options)	847,270	7.99%	632,633	6.40%	214,637	33.93%
5.賣出選擇權(Sold Options)	849,230	8.00%	640,046	6.47%	209,184	32.68%
(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)	327,274	3.08%	272,527	2.76%	54,747	20.09%
(一)店頭市場(OTC)	2,308	0.02%	2,336	0.03%	-28	-1.20%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	324,966	3.06%	270,191	2.73%	54,775	20.27%
四、商品有關契約 (Commodity Contracts)	50,958	0.48%	79,142	0.80%	-28,184	-35.61%
(一)店頭市場(OTC)	42,916	0.40%	68,799	0.70%	-25,883	-37.62%
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	8,042	0.08%	10,343	0.10%	-2,301	-22.25%
小 計(一至四)	10,603,968	99.92%	9,877,021	99.89%	726,947	7.36%
五、信用有關契約 (Credit Contracts)	8,555	0.08%	11,395	0.11%	-2,840	-24.92%
1.信用違約交換(Credit Default Swap)	8,555	0.08%	11,395	0.11%	-2,840	-24.92%
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	10,612,523	100.00%	9,888,416	100.00%	724,107	7.32%

註：1. 本表已剔除銀行間交易重複計算部分。

2. 本國銀行國內總分支機構及外國銀行在台分行係包括國際金融業務分行資料。

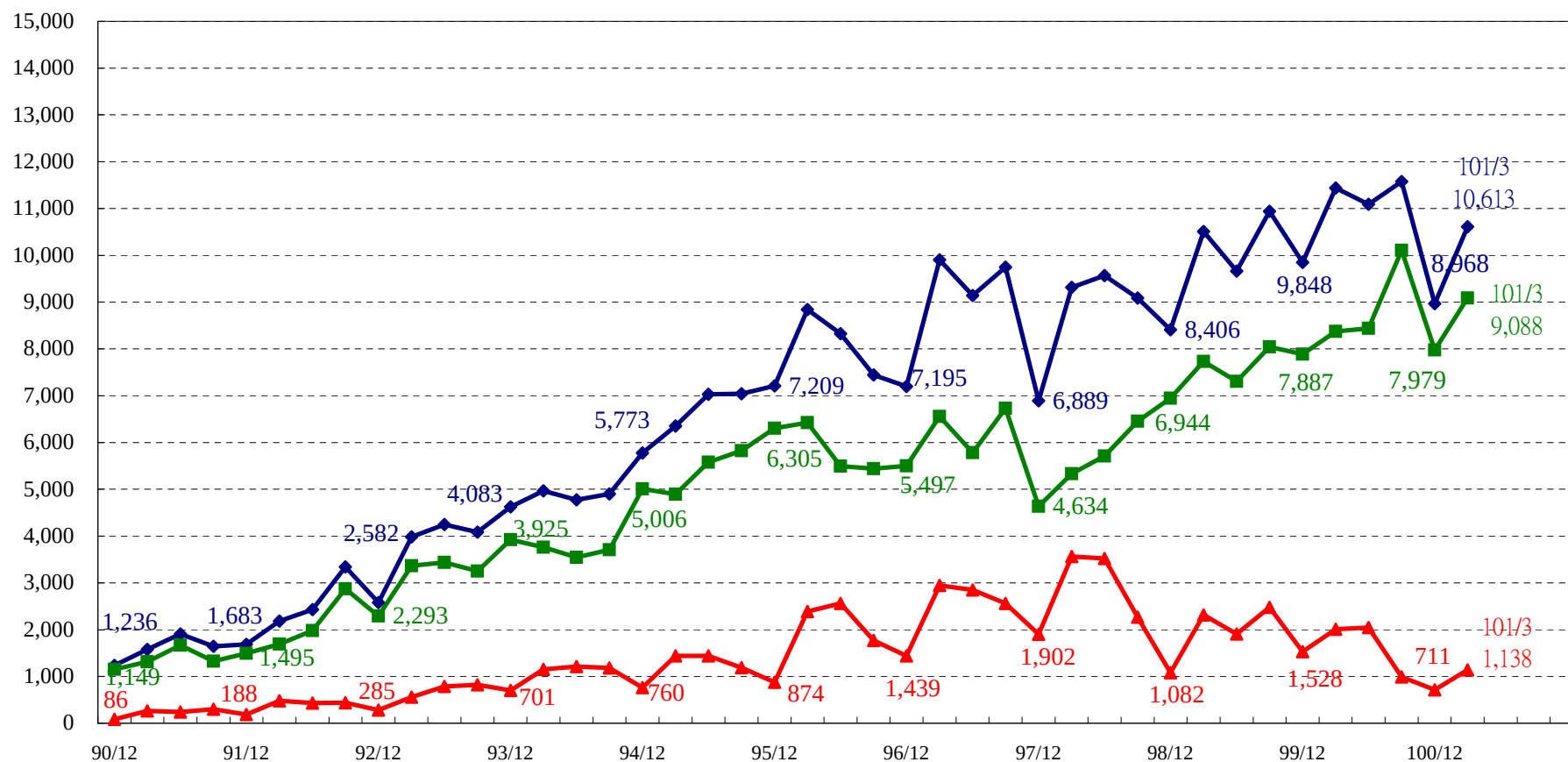
3. 「匯率有關—遠期契約」中「涉及新臺幣交易」金額包括新臺幣對外幣無本金交割遠期外匯交易；「純外幣交易」金額包括外幣保證金交易以遠期契約承作者。

4. 信用有關契約自93年1月份開始統計，其他有關契約自94年1月份開始統計。

附圖1 101年3月銀行辦理衍生性金融商品交易量統計

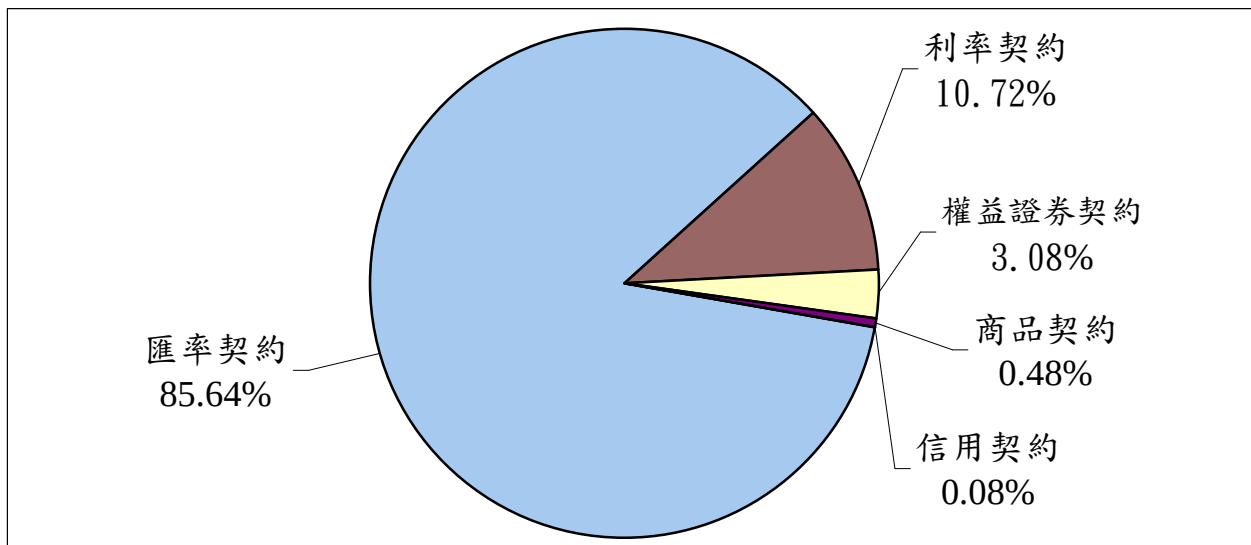
新臺幣十億元

◆ 總交易量 ■ 匯率有關契約 ▲ 利率有關契約

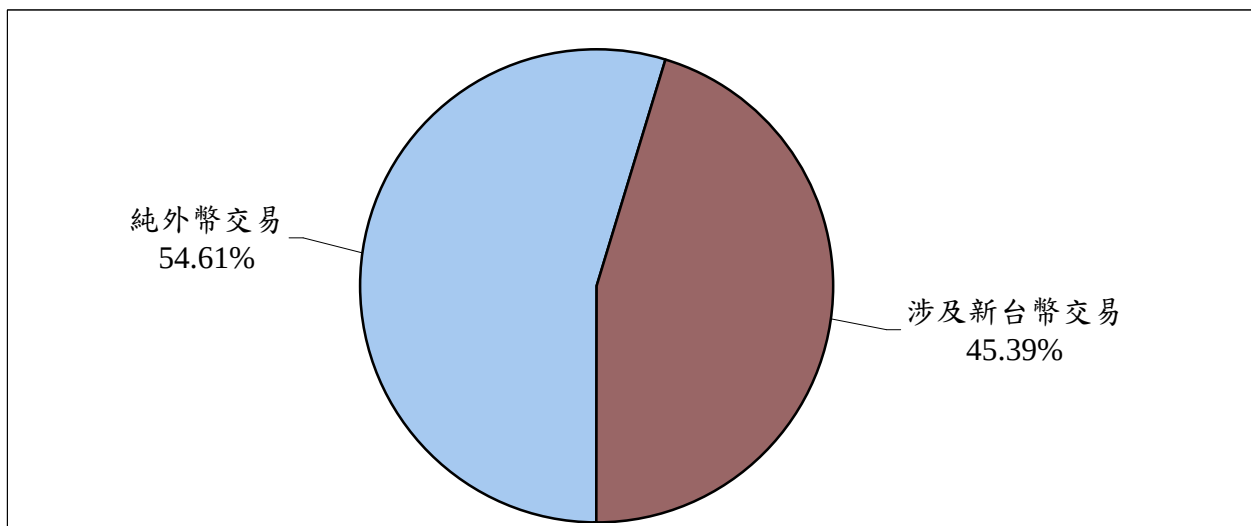


附圖2 101年3月銀行衍生性金融商品交易量內容分析

商品種類別



幣別



銀行類別

