

附表1 銀行衍生性金融商品交易量彙總表

101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)	64,015	376,176	440,191	5.39
(一)店頭市場(OTC)	64,015	96,881	160,896	1.97
1.遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-
2.換利(IRS)	59,510	90,517	150,027	1.84
3.買入選擇權(Bought Options)	1,063	-	1,063	0.01
4.賣出選擇權(Sold Options)	3,442	6,364	9,806	0.12
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	279,295	279,295	3.42
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	-	136,999	136,999	1.68
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	-	142,296	142,296	1.74
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)	4,068,798	3,276,401	7,345,199	89.95
(一)店頭市場(OTC)	4,068,798	3,276,401	7,345,199	89.95
1.遠期契約(Outright Forwards) ²	368,649	432,118	800,767	9.80
2.換匯(Fx Swaps)	3,601,941	1,809,193	5,411,134	66.27
3.換匯換利(Currency Swaps)	57,329	2,228	59,557	0.73
4.買入選擇權(Bought Options)	18,640	512,921	531,561	6.51
5.賣出選擇權(Sold Options)	22,239	519,941	542,180	6.64
(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)	337,689	8,032	345,721	4.23
(一)店頭市場(OTC)	360	1,870	2,230	0.03
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	337,329	6,162	343,491	4.20
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	1,352	29,357	30,709	0.38
(一)店頭市場(OTC)	-	22,253	22,253	0.27
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	1,352	7,104	8,456	0.11
小 計(一至四)	4,471,854	3,689,966	8,161,820	99.95
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	3,864	3,864	0.05
1.信用違約交換(Credit Default Swap)	-	3,864	3,864	0.05
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	4,471,854	3,693,830	8,165,684	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

101年12月

單位：新臺幣百萬元，%

商 品 種 類	101年12月		101年11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)	440,191	5.39	575,422	5.99	-135,231	-23.50
(一)店頭市場(OTC)	160,896	1.97	166,648	1.74	-5,752	-3.45
1. 遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-	-	-
2. 換利(IRS)	150,027	1.84	154,018	1.60	-3,991	-2.59
3. 買入選擇權(Bought Options)	1,063	0.01	1,592	0.02	-529	-33.23
4. 賣出選擇權(Sold Options)	9,806	0.12	11,038	0.12	-1,232	-11.16
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	279,295	3.42	408,774	4.25	-129,479	-31.67
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	136,999	1.68	199,109	2.07	-62,110	-31.19
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	142,296	1.74	209,665	2.18	-67,369	-32.13
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)	7,345,199	89.95	8,607,890	89.53	-1,262,691	-14.67
(一)店頭市場(OTC)	7,345,199	89.95	8,607,890	89.53	-1,262,691	-14.67
1. 遠期契約(Outright Forwards) ²	800,767	9.80	901,017	9.37	-100,250	-11.13
2. 換匯(Fx Swaps)	5,411,134	66.27	6,115,591	63.61	-704,457	-11.52
3. 換匯換利(Currency Swaps)	59,557	0.73	61,157	0.63	-1,600	-2.62
4. 買入選擇權(Bought Options)	531,561	6.51	767,033	7.98	-235,472	-30.70
5. 賣出選擇權(Sold Options)	542,180	6.64	763,092	7.94	-220,912	-28.95
(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)	345,721	4.23	385,041	4.00	-39,320	-10.21
(一)店頭市場(OTC)	2,230	0.03	4,237	0.04	-2,007	-47.37
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	343,491	4.20	380,804	3.96	-37,313	-9.80
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	30,709	0.38	39,680	0.41	-8,971	-22.61
(一)店頭市場(OTC)	22,253	0.27	29,982	0.31	-7,729	-25.78
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	8,456	0.11	9,698	0.10	-1,242	-12.81
小 計(一至四)	8,161,820	99.95	9,608,033	99.93	-1,446,213	-15.05
五、信用有關契約(Credit Contracts)	3,864	0.05	6,307	0.07	-2,443	-38.73
1. 信用違約交換(Credit Default Swap)	3,864	0.05	6,307	0.07	-2,443	-38.73
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	8,165,684	100.00	9,614,340	100.00	-1,448,656	-15.07

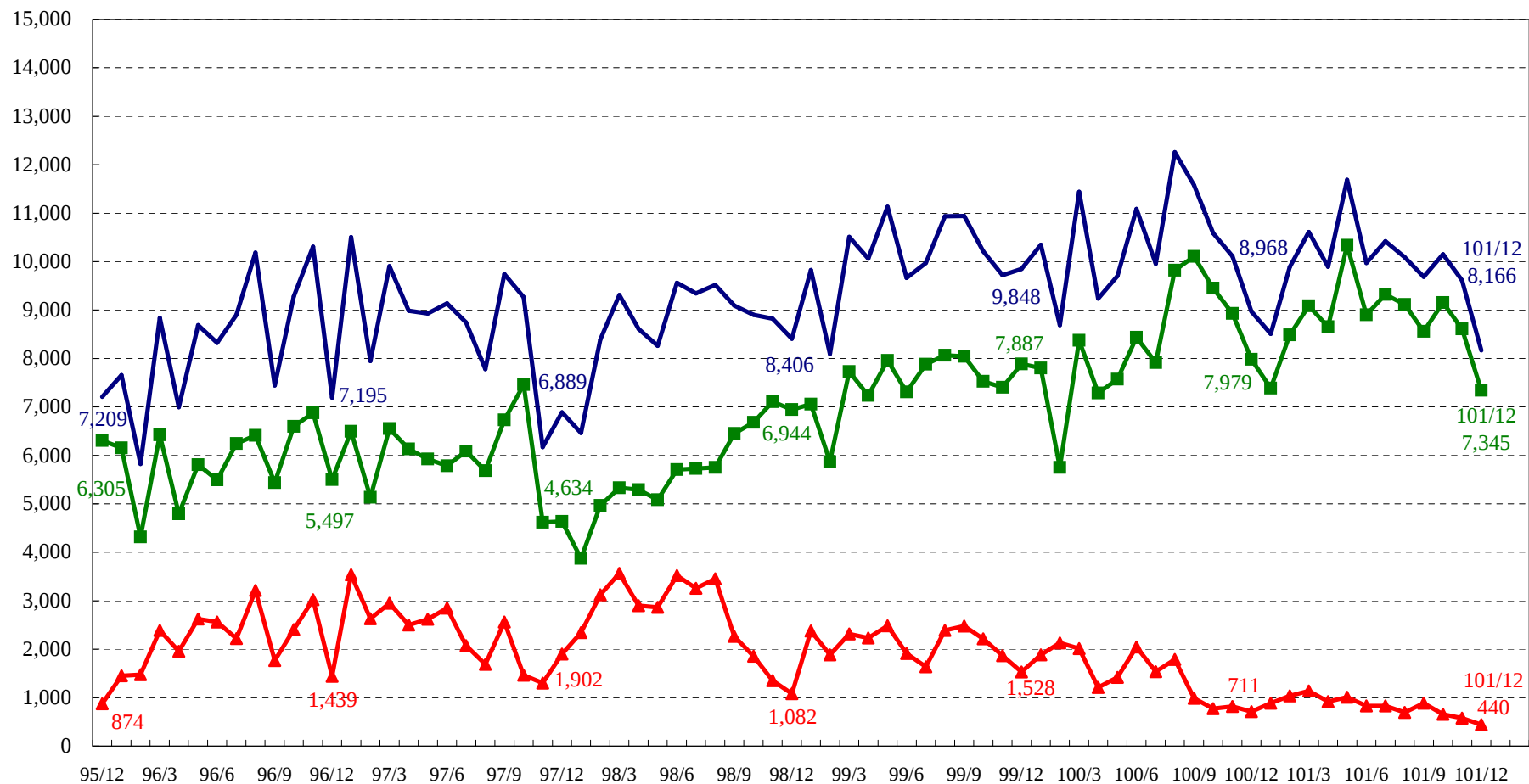
註：1. 包括國內總分支機構及國際金融業務分行資料，不含海外分行及子行；本表已剔除銀行間交易重複計算部分。

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1 101年12月銀行辦理衍生性金融商品交易量統計

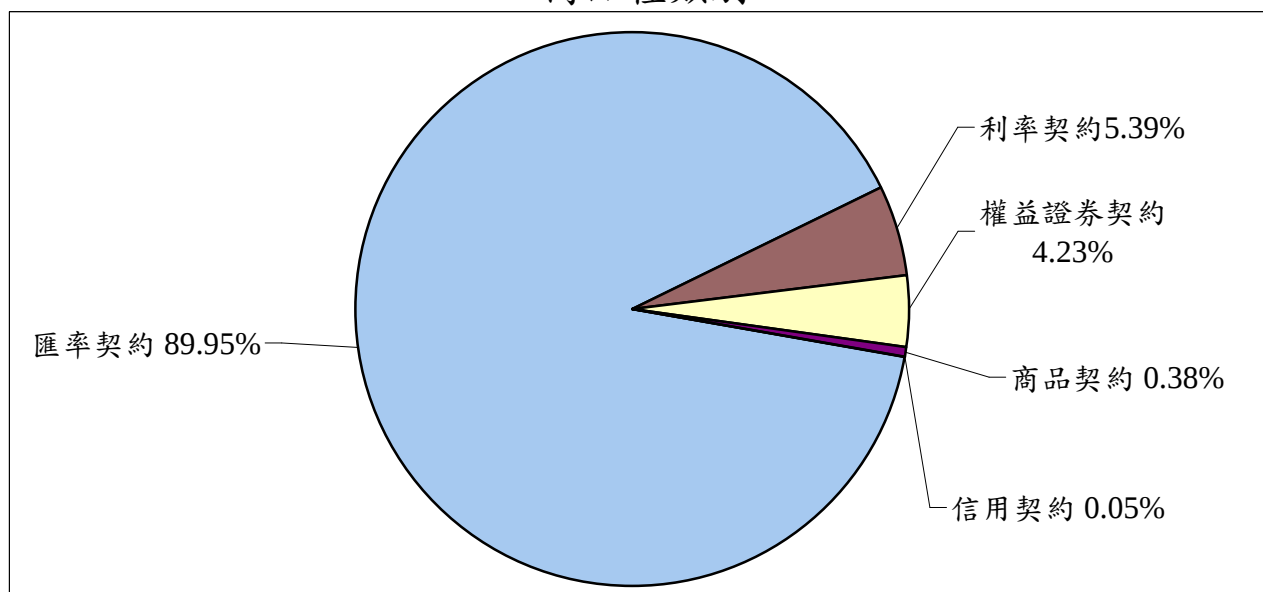
新臺幣十億元

— 總交易量 ■ 匯率有關契約 ▲ 利率有關契約

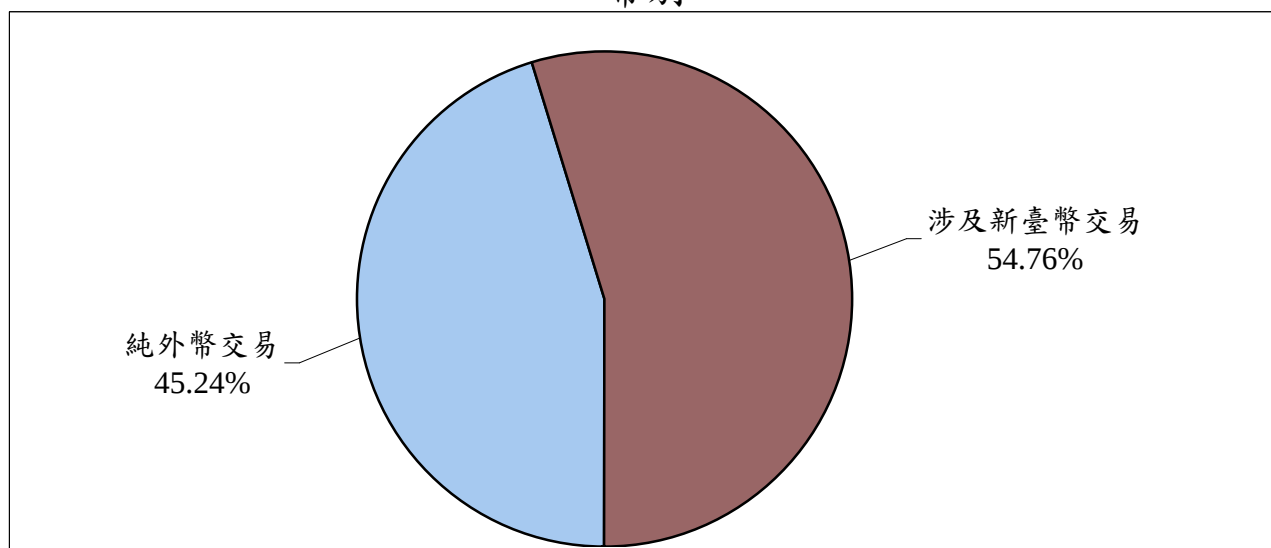


附圖2 101年12月銀行衍生性金融商品交易量內容分析

商品種類別



幣別



銀行類別

