

附表1 銀行衍生性金融商品交易量彙總表

101年10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	比重
一、利率有關契約(Interest Rate Contracts)	87,336	567,739	655,075	6.45
(一)店頭市場(OTC)	87,336	104,736	192,072	1.89
1. 遠期利率協議(FRA)	574	-	574	-
2. 換利(IRS)	71,392	95,094	166,486	1.64
3. 買入選擇權(Bought Options)	10,687	527	11,214	0.11
4. 賣出選擇權(Sold Options)	4,683	9,115	13,798	0.14
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	463,003	463,003	4.56
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	-	232,497	232,497	2.29
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	-	229,248	229,248	2.26
3. 買入選擇權(Bought Options)	-	-	-	-
4. 賣出選擇權(Sold Options)	-	1,258	1,258	0.01
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	4,493,306	4,657,537	9,150,843	90.12
(一)店頭市場(OTC)	4,493,306	4,657,537	9,150,843	90.12
1. 遠期契約(Outright Forwards)	388,154	526,190	914,344	9.01
2. 換匯(Fx Swaps)	3,983,574	2,413,943	6,397,517	63.00
3. 換匯換利(Currency Swaps)	61,116	7,616	68,732	0.68
4. 買入選擇權(Bought Options)	29,955	851,348	881,303	8.68
5. 賣出選擇權(Sold Options)	30,507	858,440	888,947	8.75
(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)	291,179	11,332	302,511	2.98
(一)店頭市場(OTC)	512	5,845	6,357	0.06
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	290,667	5,487	296,154	2.92
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	1,422	39,306	40,728	0.40
(一)店頭市場(OTC)	-	32,246	32,246	0.32
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	1,422	7,060	8,482	0.08
小 計(一至四)	4,873,243	5,275,914	10,149,157	99.95
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	4,990	4,990	0.05
1. 信用違約交換(Credit Default Swap)	-	4,990	4,990	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	4,873,243	5,280,904	10,154,147	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10月

單位：新臺幣百萬元，%

商 品 種 類	101年10月		101年9月		比較增減	
	合 計	比重	合 計	比重	合 計	變動率
一、利率有關契約(Interest Rate Contracts)	655,075	6.45	885,738	9.15	-230,663	-26.04
(一)店頭市場(OTC)	192,072	1.89	182,637	1.89	9,435	5.17
1.遠期利率協議(FRA)	574	-	-	-	574	-
2.換利(IRS)	166,486	1.64	163,942	1.69	2,544	1.55
3.買入選擇權(Bought Options)	11,214	0.11	10,206	0.11	1,008	9.88
4.賣出選擇權(Sold Options)	13,798	0.14	8,489	0.09	5,309	62.54
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	463,003	4.56	703,101	7.26	-240,098	-34.15
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	232,497	2.29	362,868	3.75	-130,371	-35.93
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	229,248	2.26	339,940	3.51	-110,692	-32.56
3.買入選擇權(Bought Options)	-	-	-	-	-	-
4.賣出選擇權(Sold Options)	1,258	0.01	293	-	965	329.35
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	9,150,843	90.12	8,561,660	88.41	589,183	6.88
(一)店頭市場(OTC)	9,150,843	90.12	8,561,660	88.41	589,183	6.88
1.遠期契約(Outright Forwards)	914,344	9.01	926,298	9.57	-11,954	-1.29
2.換匯(Fx Swaps)	6,397,517	63.00	6,004,696	62.01	392,821	6.54
3.換匯換利(Currency Swaps)	68,732	0.68	56,316	0.58	12,416	22.05
4.買入選擇權(Bought Options)	881,303	8.68	791,671	8.17	89,632	11.32
5.賣出選擇權(Sold Options)	888,947	8.75	782,679	8.08	106,268	13.58
(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)	302,511	2.98	198,924	2.05	103,587	52.07
(一)店頭市場(OTC)	6,357	0.06	3,750	0.04	2,607	69.52
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	296,154	2.92	195,174	2.01	100,980	51.74
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	40,728	0.40	35,696	0.37	5,032	14.10
(一)店頭市場(OTC)	32,246	0.32	31,862	0.33	384	1.21
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	8,482	0.08	3,834	0.04	4,648	121.23
小 計(一至四)	10,149,157	99.95	9,682,018	99.98	467,139	4.82
五、信用有關契約(Credit Contracts)	4,990	0.05	1,867	0.02	3,123	167.27
1.信用違約交換(Credit Default Swap)	4,990	0.05	1,867	0.02	3,123	167.27
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	10,154,147	100.00	9,683,885	100.00	470,262	4.86

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。

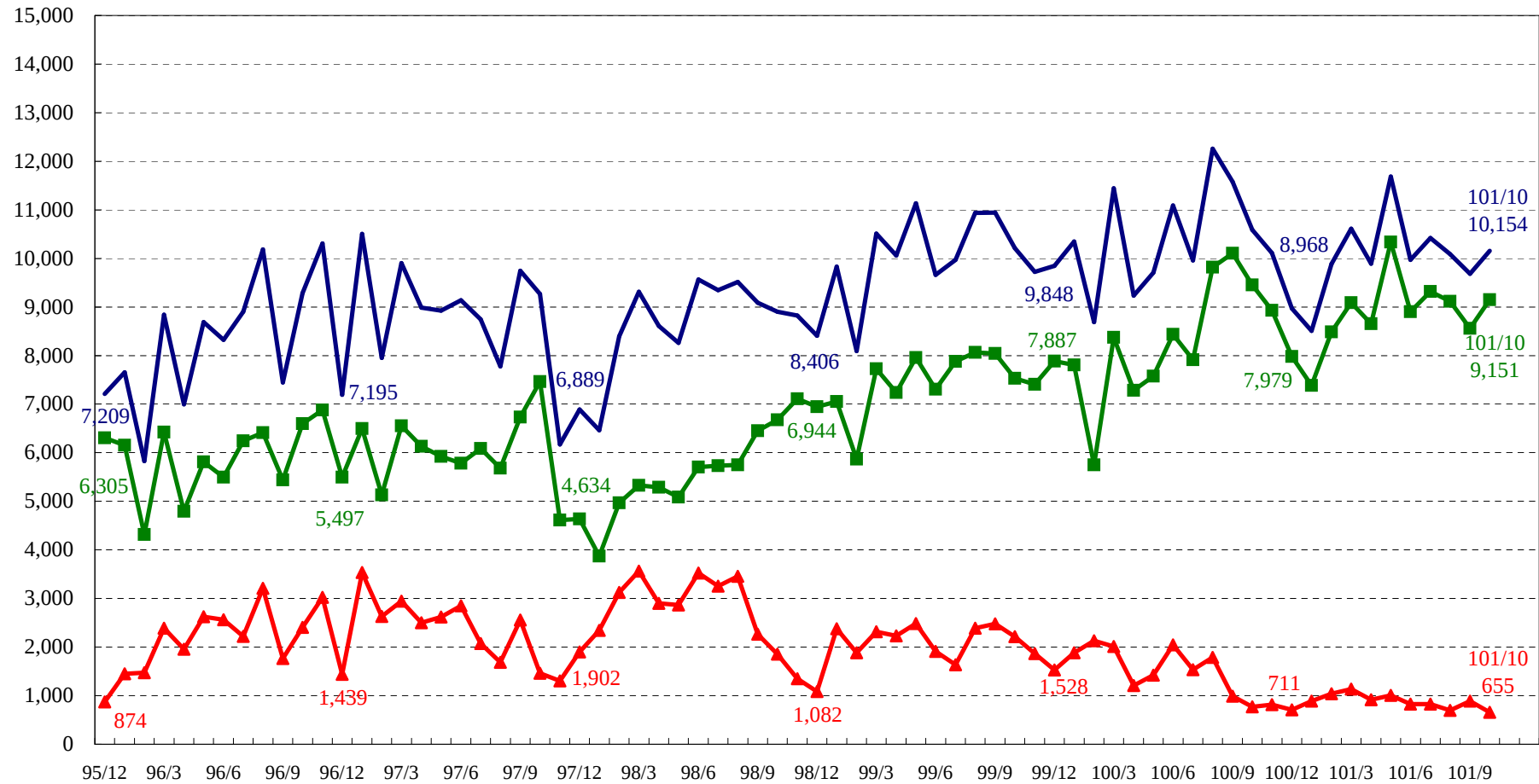
3.「匯率有關—遠期契約」中「涉及新臺幣交易」金額包括新臺幣對外幣無本金交割遠期外匯交易；「純外幣交易」金額包括外幣保證金交易以遠期契約承作者。

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10月銀行辦理衍生性金融商品交易量統計

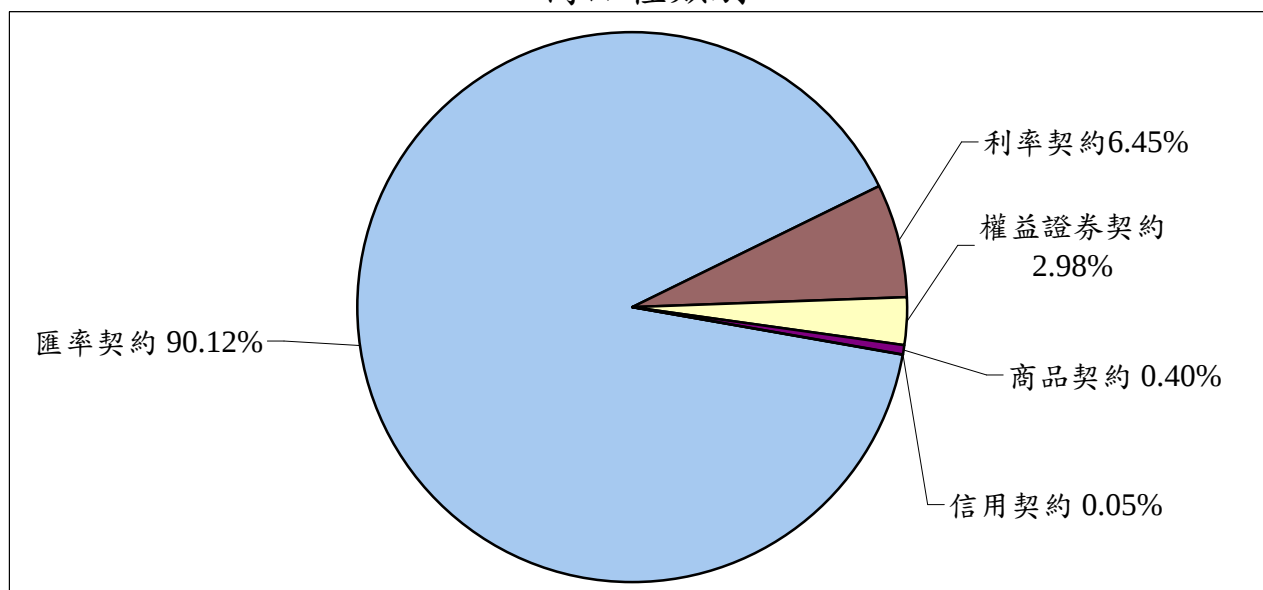
新臺幣十億元

— 總交易量 ■ 匯率有關契約 ▲ 利率有關契約

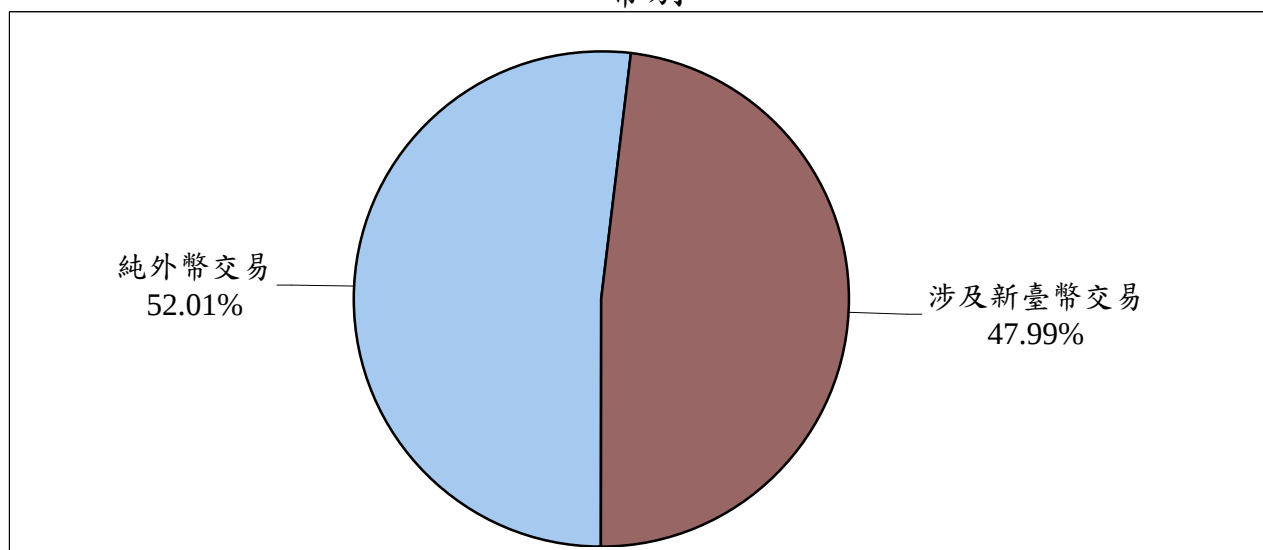


附圖2 101年10月銀行衍生性金融商品交易量內容分析

商品種類別



幣別



銀行類別

