

附表1 銀行衍生性金融商品交易量彙總表

103年1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)	125,519	375,156	500,675	2.91
(一)店頭市場(OTC)	125,519	56,399	181,918	1.06
1.遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-
2.換利(IRS)	121,106	52,985	174,091	1.01
3.買入選擇權(Bought Options)	1,352	720	2,072	0.01
4.賣出選擇權(Sold Options)	3,061	2,694	5,755	0.04
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	318,757	318,757	1.85
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	-	157,938	157,938	0.92
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	-	160,819	160,819	0.93
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)	5,171,853	11,135,047	16,306,900	94.78
(一)店頭市場(OTC)	5,171,853	11,135,047	16,306,900	94.78
1.遠期契約(Outright Forwards) ²	338,316	740,610	1,078,926	6.27
2.換匯(Fx Swaps)	4,674,486	3,258,961	7,933,447	46.11
3.換匯換利(Currency Swaps)	49,789	8,494	58,283	0.34
4.買入選擇權(Bought Options)	56,566	3,459,170	3,515,736	20.43
5.賣出選擇權(Sold Options)	52,696	3,667,812	3,720,508	21.63
(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)	358,586	10,044	368,630	2.14
(一)店頭市場(OTC)	4,910	2,614	7,524	0.04
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	353,676	7,430	361,106	2.10
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	940	22,347	23,287	0.14
(一)店頭市場(OTC)	-	12,460	12,460	0.07
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	940	9,887	10,827	0.07
小 計(一至四)	5,656,898	11,542,594	17,199,492	99.97
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	5,671	5,671	0.03
1.信用違約交換(Credit Default Swap)	-	5,671	5,671	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	5,656,898	11,548,265	17,205,163	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

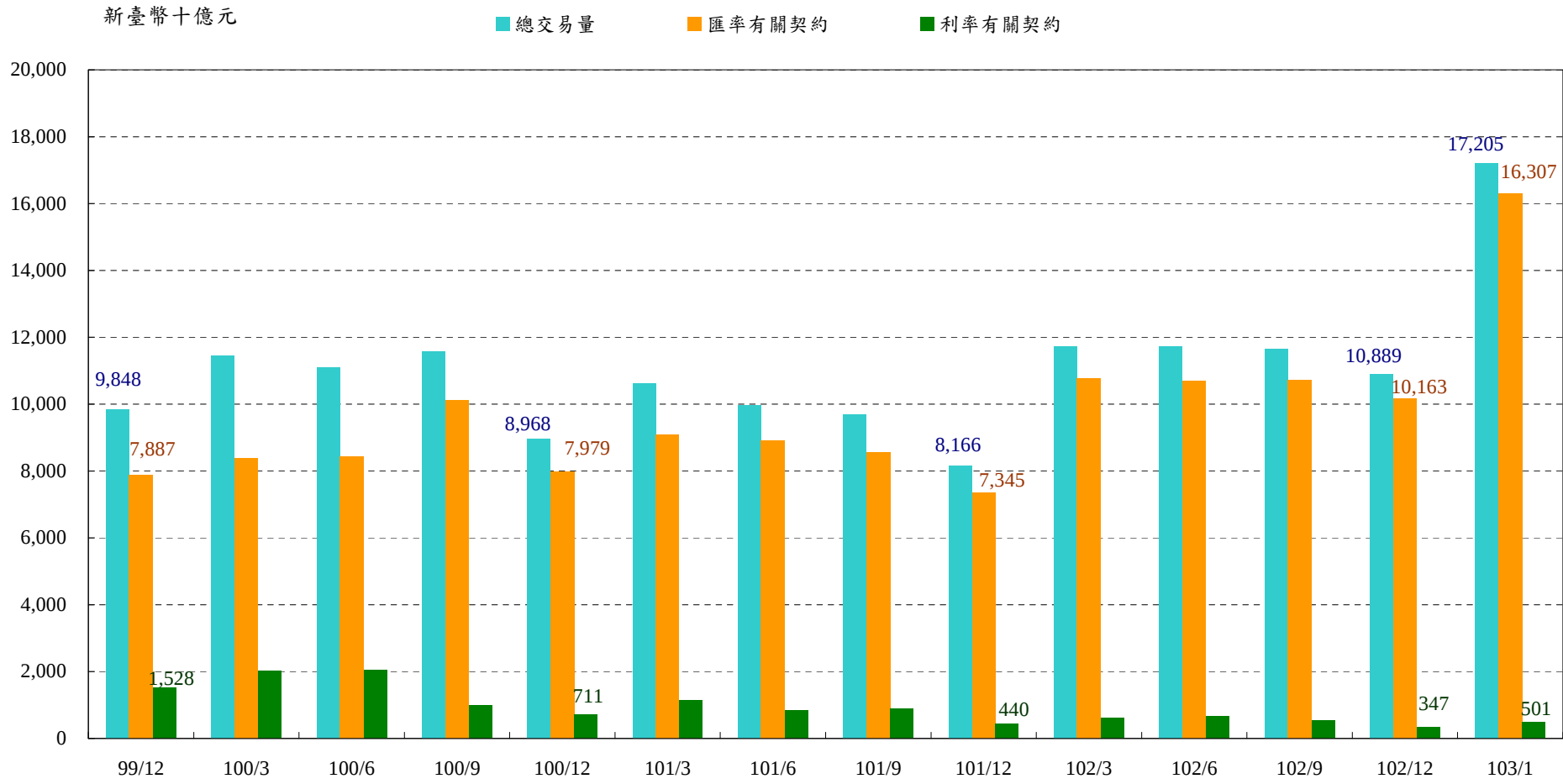
單位：新臺幣百萬元；%

商 品 種 類	103年1月		102年12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)	500,675	2.91	347,454	3.19	153,221	44.10
(一)店頭市場(OTC)	181,918	1.06	88,757	0.81	93,161	104.96
1. 遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-	-	-
2. 換利(IRS)	174,091	1.01	77,405	0.71	96,686	124.91
3. 買入選擇權(Bought Options)	2,072	0.01	4,388	0.04	-2,316	-52.78
4. 賣出選擇權(Sold Options)	5,755	0.04	6,964	0.06	-1,209	-17.36
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	318,757	1.85	258,697	2.38	60,060	23.22
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	157,938	0.92	130,598	1.20	27,340	20.93
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	160,819	0.93	128,099	1.18	32,720	25.54
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)	16,306,900	94.78	10,162,943	93.33	6,143,957	60.45
(一)店頭市場(OTC)	16,306,900	94.78	10,162,943	93.33	6,143,957	60.45
1. 遠期契約(Outright Forwards) ²	1,078,926	6.27	804,118	7.39	274,808	34.18
2. 換匯(Fx Swaps)	7,933,447	46.11	7,717,996	70.88	215,451	2.79
3. 換匯換利(Currency Swaps)	58,283	0.34	85,292	0.78	-27,009	-31.67
4. 買入選擇權(Bought Options)	3,515,736	20.43	765,809	7.03	2,749,927	359.09
5. 賣出選擇權(Sold Options)	3,720,508	21.63	789,728	7.25	2,930,780	371.11
(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)	368,630	2.14	357,102	3.28	11,528	3.23
(一)店頭市場(OTC)	7,524	0.04	2,514	0.02	5,010	199.28
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	361,106	2.10	354,588	3.26	6,518	1.84
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	23,287	0.14	18,597	0.17	4,690	25.22
(一)店頭市場(OTC)	12,460	0.07	11,211	0.10	1,249	11.14
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	10,827	0.07	7,386	0.07	3,441	46.59
小 計(一至四)	17,199,492	99.97	10,886,096	99.97	6,313,396	58.00
五、信用有關契約(Credit Contracts)	5,671	0.03	2,829	0.03	2,842	100.46
1. 信用違約交換(Credit Default Swap)	5,671	0.03	2,829	0.03	2,842	100.46
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	17,205,163	100.00	10,888,925	100.00	6,316,238	58.01

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。

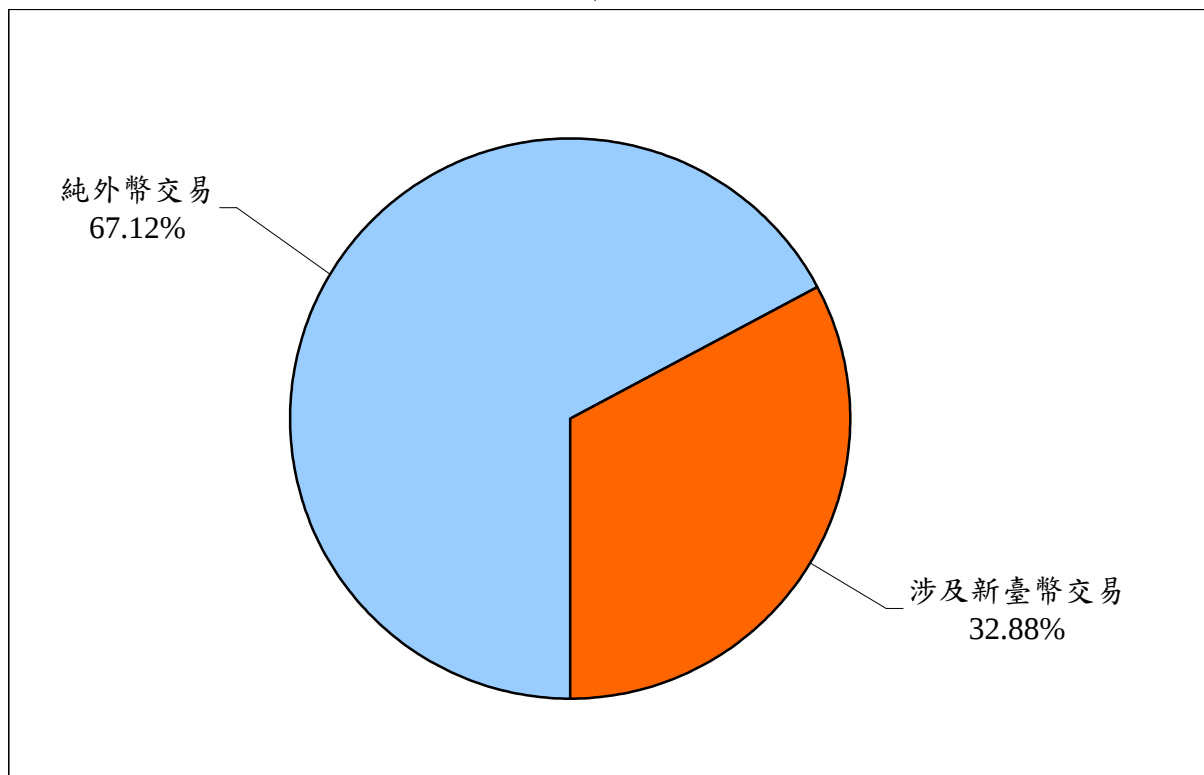
2. 「匯率有關—遠期契約」中「涉及新臺幣交易」金額包括新臺幣對外幣無本金交割遠期外匯交易；「純外幣交易」金額包括外幣保證金交易以遠期契約承作者。

附圖1 103年1月銀行辦理衍生性金融商品交易量統計



附圖2 103年1月銀行衍生性金融商品交易量內容分析

幣別



銀行類別

