

附表1 銀行衍生性金融商品交易量彙總表

102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)	53,808	293,646	347,454	3.19
(一)店頭市場(OTC)	53,808	34,949	88,757	0.81
1.遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-
2.換利(IRS)	46,631	30,774	77,405	0.71
3.買入選擇權(Bought Options)	3,640	748	4,388	0.04
4.賣出選擇權(Sold Options)	3,537	3,427	6,964	0.06
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	258,697	258,697	2.38
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	-	130,598	130,598	1.20
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	-	128,099	128,099	1.18
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)	5,086,147	5,076,796	10,162,943	93.33
(一)店頭市場(OTC)	5,086,147	5,076,796	10,162,943	93.33
1.遠期契約(Outright Forwards) ²	232,875	571,243	804,118	7.39
2.換匯(Fx Swaps)	4,727,155	2,990,841	7,717,996	70.88
3.換匯換利(Currency Swaps)	81,409	3,883	85,292	0.78
4.買入選擇權(Bought Options)	22,893	742,916	765,809	7.03
5.賣出選擇權(Sold Options)	21,815	767,913	789,728	7.25
(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)	354,982	2,120	357,102	3.28
(一)店頭市場(OTC)	1,488	1,026	2,514	0.02
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	353,494	1,094	354,588	3.26
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	1,292	17,305	18,597	0.17
(一)店頭市場(OTC)	-	11,211	11,211	0.10
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	1,292	6,094	7,386	0.07
小 計(一至四)	5,496,229	5,389,867	10,886,096	99.97
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	2,829	2,829	0.03
1.信用違約交換(Credit Default Swap)	-	2,829	2,829	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	5,496,229	5,392,696	10,888,925	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

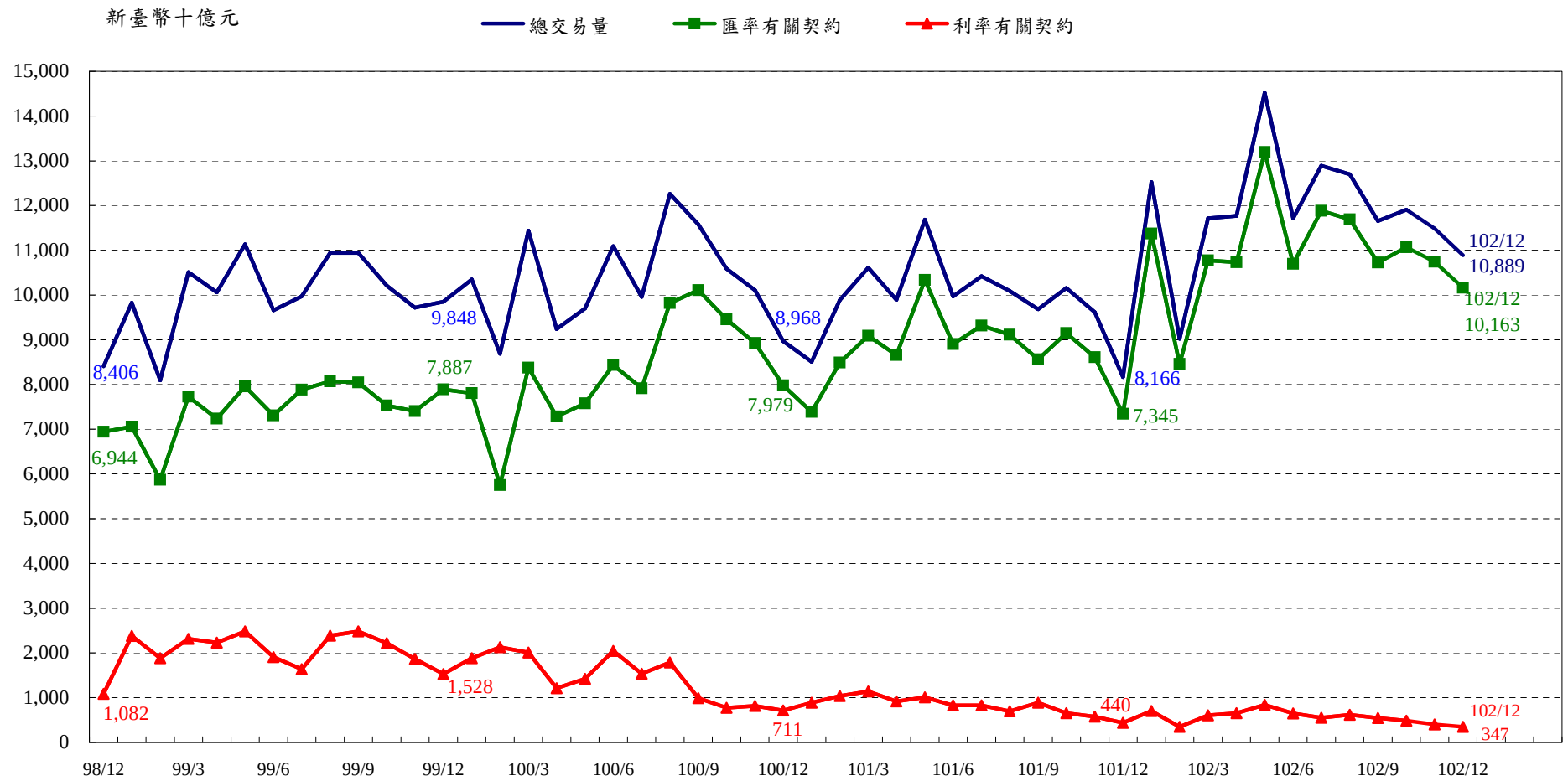
單位：新臺幣百萬元；%

商 品 種 類	102年12月		102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)	347,454	3.19	399,187	3.47	-51,733	-12.96
(一)店頭市場(OTC)	88,757	0.81	117,393	1.02	-28,636	-24.39
1. 遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-	-	-
2. 換利(IRS)	77,405	0.71	98,374	0.86	-20,970	-21.32
3. 買入選擇權(Bought Options)	4,388	0.04	11,827	0.10	-7,439	-62.90
4. 賣出選擇權(Sold Options)	6,964	0.06	7,192	0.06	-229	-3.18
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	258,697	2.38	281,794	2.45	-23,097	-8.20
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	130,598	1.20	142,165	1.24	-11,567	-8.14
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	128,099	1.18	139,629	1.21	-11,530	-8.26
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)	10,162,943	93.33	10,741,008	93.50	-578,065	-5.38
(一)店頭市場(OTC)	10,162,943	93.33	10,741,008	93.50	-578,065	-5.38
1. 遠期契約(Outright Forwards) ²	804,118	7.39	982,106	8.55	-177,989	-18.12
2. 換匯(Fx Swaps)	7,717,996	70.88	7,344,404	63.93	373,592	5.09
3. 換匯換利(Currency Swaps)	85,292	0.78	93,396	0.81	-8,105	-8.68
4. 買入選擇權(Bought Options)	765,809	7.03	1,153,200	10.04	-387,391	-33.59
5. 賣出選擇權(Sold Options)	789,728	7.25	1,167,902	10.17	-378,175	-32.38
(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)	357,102	3.28	331,153	2.89	25,949	7.84
(一)店頭市場(OTC)	2,514	0.02	1,785	0.02	729	40.81
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	354,588	3.26	329,368	2.87	25,220	7.66
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	18,597	0.17	15,273	0.13	3,324	21.76
(一)店頭市場(OTC)	11,211	0.10	9,754	0.08	1,457	14.94
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	7,386	0.07	5,519	0.05	1,867	33.83
小 計(一至四)	10,886,096	99.97	11,486,621	99.99	-600,525	-5.23
五、信用有關契約(Credit Contracts)	2,829	0.03	903	0.01	1,926	213.29
1. 信用違約交換(Credit Default Swap)	2,829	0.03	903	0.01	1,926	213.29
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	10,888,925	100.00	11,487,524	100.00	-598,599	-5.21

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。

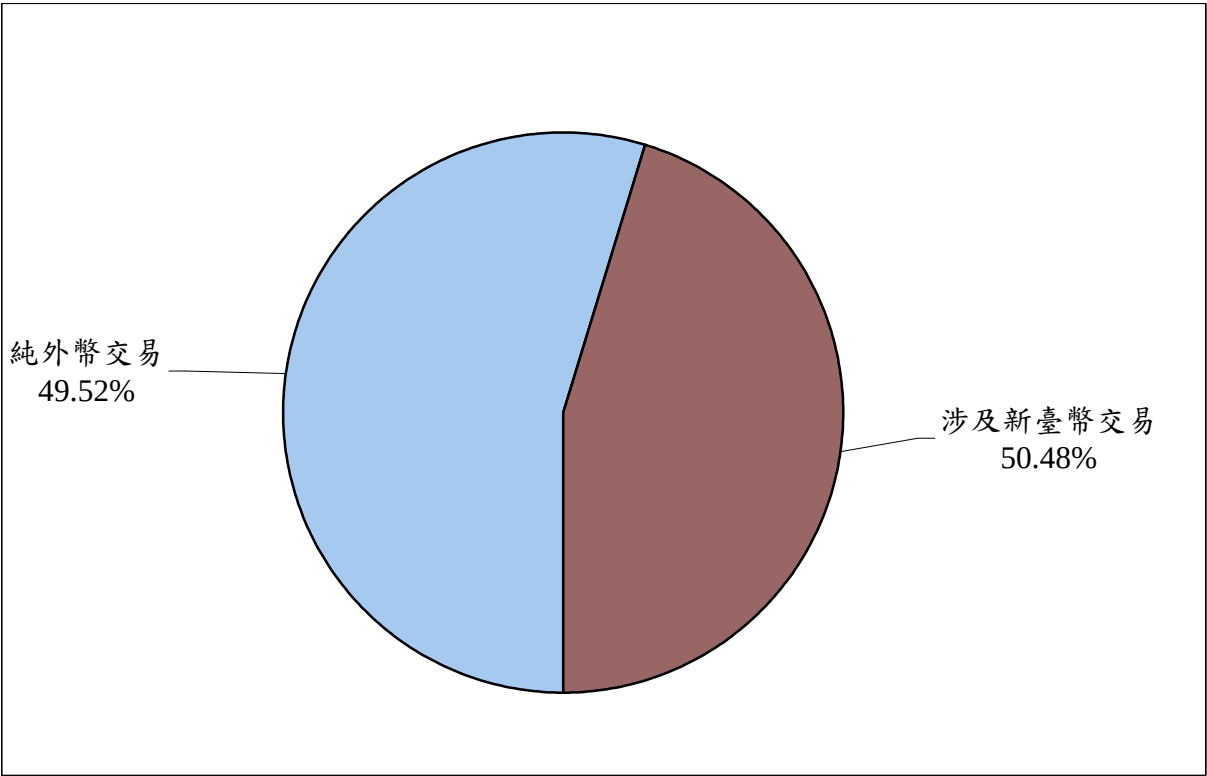
2. 「匯率有關—遠期契約」中「涉及新臺幣交易」金額包括新臺幣對外幣無本金交割遠期外匯交易；「純外幣交易」金額包括外幣保證金交易以遠期契約承作者。

附圖1 102年12月銀行辦理衍生性金融商品交易量統計



附圖2 102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

