

# 附表1 銀行衍生性金融商品交易量彙總表

103年5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 <sup>1</sup> |                  |                   |               |
|------------------------------------------------|----------------------------|------------------|-------------------|---------------|
|                                                | 涉及新臺幣交易                    | 純外幣交易            | 合 計               | 比重            |
| <b>一、利率有關契約(Interest Rate Contracts)</b>       | <b>88,534</b>              | <b>659,938</b>   | <b>748,472</b>    | <b>6.23</b>   |
| (一)店頭市場(OTC)                                   | 88,534                     | 58,025           | 146,559           | 1.22          |
| 1.遠期利率協議(FRA)                                  | -                          | -                | -                 | -             |
| 2.換利(IRS)                                      | 84,611                     | 55,402           | 140,013           | 1.16          |
| 3.買入選擇權(Bought Options)                        | 933                        | -                | 933               | 0.01          |
| 4.賣出選擇權(Sold Options)                          | 2,990                      | 2,623            | 5,613             | 0.05          |
| (二)交易所(Exchange-traded Contracts)              | -                          | 601,913          | 601,913           | 5.01          |
| 1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)             | -                          | 292,658          | 292,658           | 2.44          |
| 2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)            | -                          | 291,225          | 291,225           | 2.42          |
| 3.買入選擇權(Bought Options)                        | -                          | 12,020           | 12,020            | 0.10          |
| 4.賣出選擇權(Sold Options)                          | -                          | 6,010            | 6,010             | 0.05          |
| <b>二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)</b> | <b>4,855,684</b>           | <b>5,768,764</b> | <b>10,624,448</b> | <b>88.39</b>  |
| (一)店頭市場(OTC)                                   | 4,855,684                  | 5,768,764        | 10,624,448        | 88.39         |
| 1.遠期契約(Outright Forwards) <sup>2</sup>         | 279,501                    | 637,656          | 917,157           | 7.63          |
| 2.換匯(Fx Swaps)                                 | 4,440,941                  | 3,895,235        | 8,336,176         | 69.35         |
| 3.換匯換利(Currency Swaps)                         | 86,669                     | 16,356           | 103,025           | 0.86          |
| 4.買入選擇權(Bought Options)                        | 25,632                     | 600,093          | 625,725           | 5.21          |
| 5.賣出選擇權(Sold Options)                          | 22,941                     | 619,424          | 642,365           | 5.34          |
| (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)                          | -                          | -                | -                 | -             |
| <b>三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)</b>     | <b>547,469</b>             | <b>9,276</b>     | <b>556,745</b>    | <b>4.63</b>   |
| (一)店頭市場(OTC)                                   | 5,317                      | 468              | 5,785             | 0.05          |
| (二)交易所(Exchange-traded Contracts)              | 542,152                    | 8,808            | 550,960           | 4.58          |
| <b>四、商品有關契約(Commodity Contracts)</b>           | <b>951</b>                 | <b>87,246</b>    | <b>88,197</b>     | <b>0.73</b>   |
| (一)店頭市場(OTC)                                   | -                          | 12,363           | 12,363            | 0.10          |
| (二)交易所(Exchange-traded Contracts)              | 951                        | 74,883           | 75,834            | 0.63          |
| <b>小 計(一至四)</b>                                | <b>5,492,638</b>           | <b>6,525,224</b> | <b>12,017,862</b> | <b>99.98</b>  |
| <b>五、信用有關契約(Credit Contracts)</b>              | <b>-</b>                   | <b>2,580</b>     | <b>2,580</b>      | <b>0.02</b>   |
| 1.信用違約交換(Credit Default Swap)                  | -                          | 2,580            | 2,580             | 0.02          |
| 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)                                    | -                          | -                | -                 | -             |
| <b>六、其他有關契約(Other Contracts)</b>               | <b>-</b>                   | <b>-</b>         | <b>-</b>          | <b>-</b>      |
| 1.遠期契約(Outright Forwards)                      | -                          | -                | -                 | -             |
| 2.交換(Swaps)                                    | -                          | -                | -                 | -             |
| 3.選擇權(Options)                                 | -                          | -                | -                 | -             |
| <b>總 計</b>                                     | <b>5,492,638</b>           | <b>6,527,804</b> | <b>12,020,442</b> | <b>100.00</b> |

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

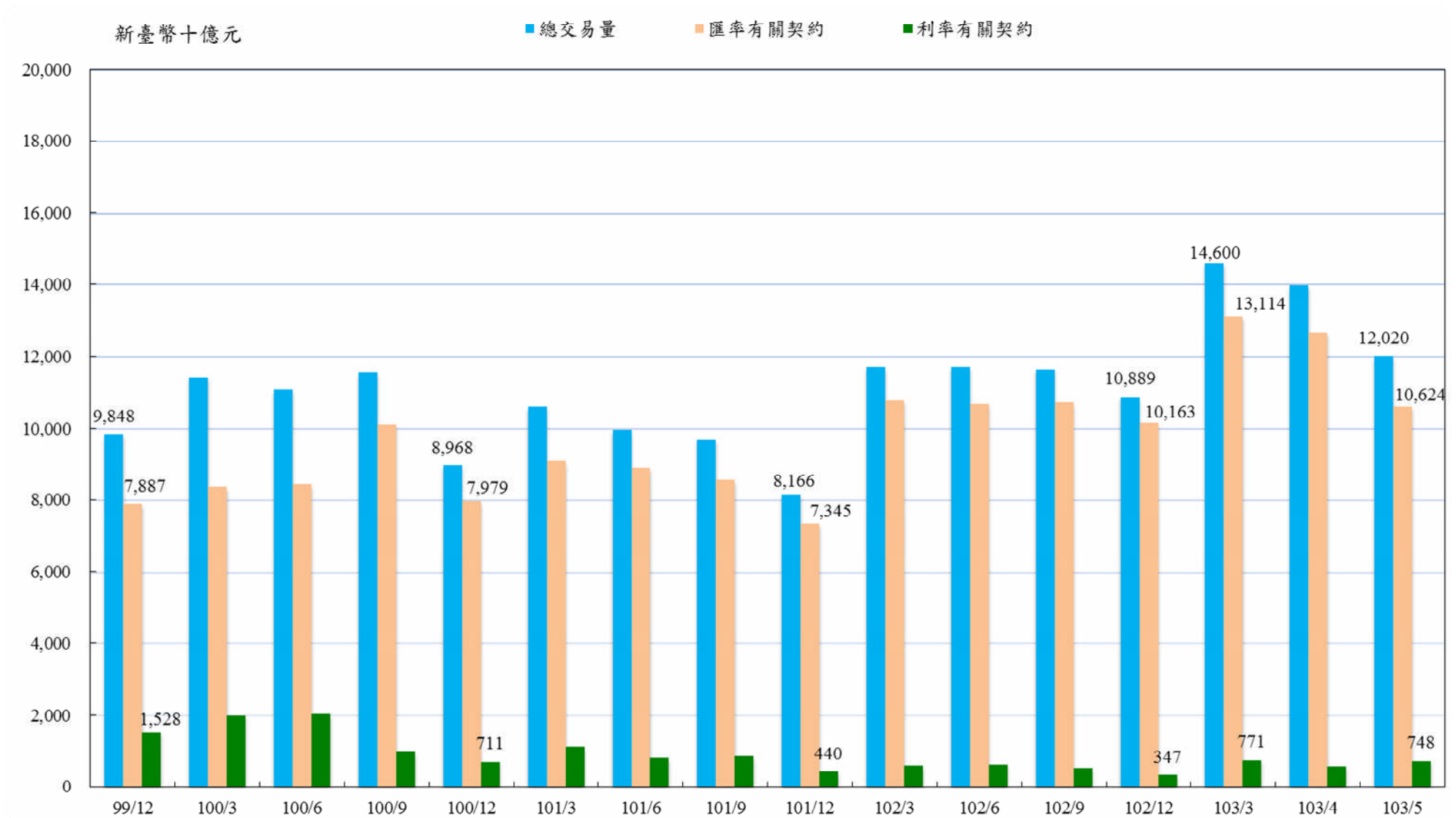
單位：新臺幣百萬元；%

| 商 品 種 類                                        | 103年5月          |        | 103年4月     |        | 比較增減       |         |
|------------------------------------------------|-----------------|--------|------------|--------|------------|---------|
|                                                | 合計 <sup>1</sup> | 比重     | 合計         | 比重     | 差 額        | 變動率     |
| <b>一、利率有關契約(Interest Rate Contracts)</b>       | 748,472         | 6.23   | 605,394    | 4.33   | 143,078    | 23.63   |
| (一)店頭市場(OTC)                                   | 146,559         | 1.22   | 153,448    | 1.10   | -6,889     | -4.49   |
| 1. 遠期利率協議(FRA)                                 | -               | -      | 7,895      | 0.06   | -7,895     | -100.00 |
| 2. 換利(IRS)                                     | 140,013         | 1.16   | 138,719    | 0.99   | 1,294      | 0.93    |
| 3. 買入選擇權(Bought Options)                       | 933             | 0.01   | 2,220      | 0.02   | -1,287     | -57.97  |
| 4. 賣出選擇權(Sold Options)                         | 5,613           | 0.05   | 4,614      | 0.03   | 999        | 21.65   |
| (二)交易所(Exchange-traded Contracts)              | 601,913         | 5.01   | 451,946    | 3.23   | 149,967    | 33.18   |
| 1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)            | 292,658         | 2.44   | 212,962    | 1.52   | 79,696     | 37.42   |
| 2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)           | 291,225         | 2.42   | 219,317    | 1.57   | 71,908     | 32.79   |
| 3. 買入選擇權(Bought Options)                       | 12,020          | 0.10   | 7,564      | 0.05   | 4,456      | 58.91   |
| 4. 賣出選擇權(Sold Options)                         | 6,010           | 0.05   | 12,103     | 0.09   | -6,093     | -50.34  |
| <b>二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)</b> | 10,624,448      | 88.39  | 12,679,576 | 90.74  | -2,055,128 | -16.21  |
| (一)店頭市場(OTC)                                   | 10,624,448      | 88.39  | 12,679,576 | 90.74  | -2,055,128 | -16.21  |
| 1. 遠期契約(Outright Forwards) <sup>2</sup>        | 917,157         | 7.63   | 1,103,839  | 7.90   | -186,682   | -16.91  |
| 2. 換匯(Fx Swaps)                                | 8,336,176       | 69.35  | 9,333,914  | 66.80  | -997,738   | -10.69  |
| 3. 換匯換利(Currency Swaps)                        | 103,025         | 0.86   | 72,463     | 0.52   | 30,562     | 42.18   |
| 4. 買入選擇權(Bought Options)                       | 625,725         | 5.21   | 1,065,566  | 7.62   | -439,841   | -41.28  |
| 5. 賣出選擇權(Sold Options)                         | 642,365         | 5.34   | 1,103,794  | 7.90   | -461,429   | -41.80  |
| (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)                         | -               | -      | -          | -      | -          | -       |
| <b>三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)</b>     | 556,745         | 4.63   | 640,043    | 4.58   | -83,298    | -13.01  |
| (一)店頭市場(OTC)                                   | 5,785           | 0.05   | 2,600      | 0.02   | 3,185      | 122.50  |
| (二)交易所(Exchange-traded Contracts)              | 550,960         | 4.58   | 637,443    | 4.56   | -86,483    | -13.57  |
| <b>四、商品有關契約(Commodity Contracts)</b>           | 88,197          | 0.73   | 44,230     | 0.32   | 43,967     | 99.41   |
| (一)店頭市場(OTC)                                   | 12,363          | 0.10   | 8,077      | 0.06   | 4,286      | 53.06   |
| (二)交易所(Exchange-traded Contracts)              | 75,834          | 0.63   | 36,153     | 0.26   | 39,681     | 109.76  |
| <b>小 計(一至四)</b>                                | 12,017,862      | 99.98  | 13,969,243 | 99.97  | -1,951,381 | -13.97  |
| <b>五、信用有關契約(Credit Contracts)</b>              | 2,580           | 0.02   | 4,022      | 0.03   | -1,442     | -35.85  |
| 1. 信用違約交換(Credit Default Swap)                 | 2,580           | 0.02   | 2,094      | 0.02   | 486        | 23.21   |
| 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)                                   | -               | -      | 1,928      | 0.01   | -1,928     | -100.00 |
| <b>六、其他有關契約(Other Contracts)</b>               | -               | -      | -          | -      | -          | -       |
| 1. 遠期契約(Outright Forwards)                     | -               | -      | -          | -      | -          | -       |
| 2. 交換(Swaps)                                   | -               | -      | -          | -      | -          | -       |
| 3. 選擇權(Options)                                | -               | -      | -          | -      | -          | -       |
| <b>總 計</b>                                     | 12,020,442      | 100.00 | 13,973,265 | 100.00 | -1,952,823 | -13.98  |

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。

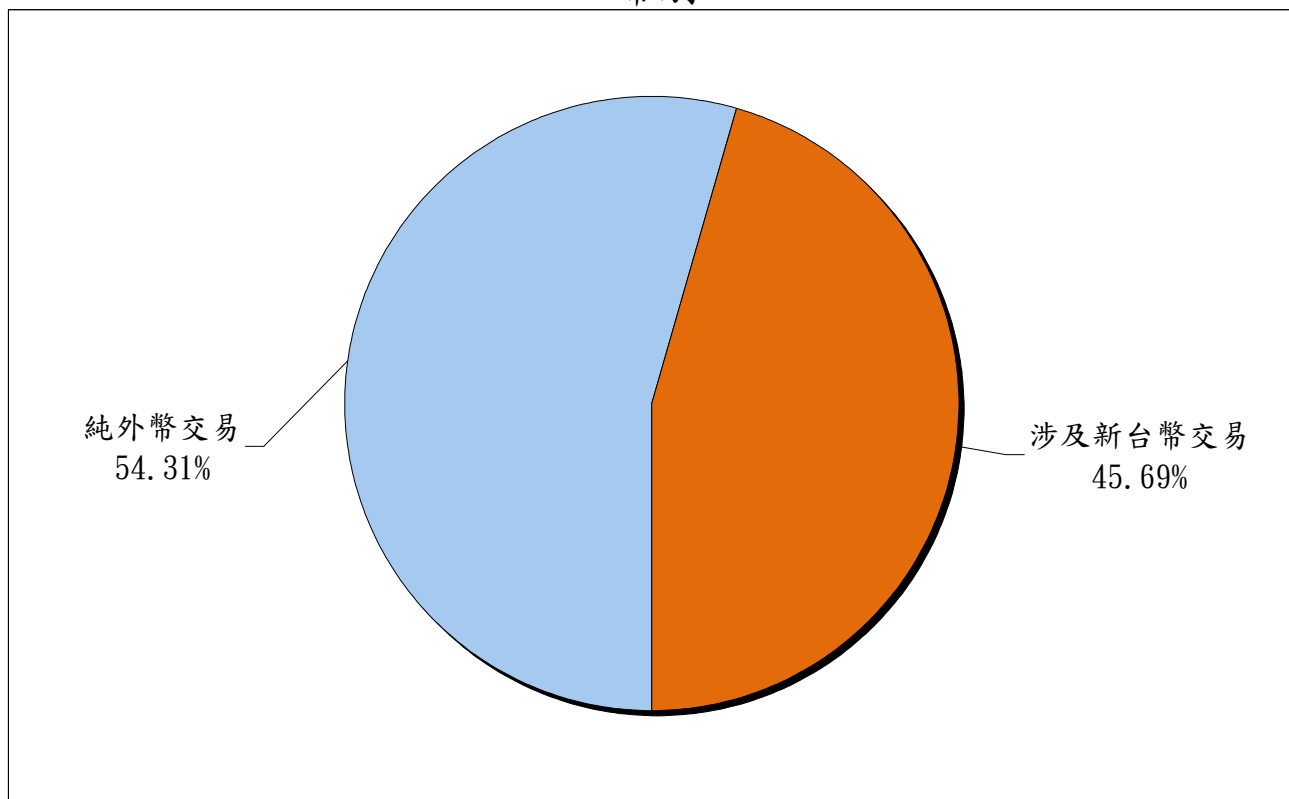
2. 「匯率有關—遠期契約」中「涉及新臺幣交易」金額包括新臺幣對外幣無本金交割遠期外匯交易；「純外幣交易」金額包括外幣保證金交易以遠期契約承作者。

附圖1 銀行辦理衍生性金融商品交易量統計



附圖2 103年5月銀行衍生性金融商品交易量內容分析

幣別



銀行類別

