

附表1 銀行衍生性金融商品交易量彙總表

104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)	97,591	425,443	523,034	3.46
(一)店頭市場(OTC)	97,591	116,279	213,870	1.42
1.遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-
2.換利(IRS)	92,495	113,046	205,541	1.36
3.買入選擇權(Bought Options)	943	-	943	0.01
4.賣出選擇權(Sold Options)	4,153	3,233	7,386	0.05
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	309,164	309,164	2.04
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	-	160,217	160,217	1.06
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	-	148,947	148,947	0.98
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)	5,276,379	8,857,867	14,134,246	93.30
(一)店頭市場(OTC)	5,276,379	8,857,867	14,134,246	93.30
1.遠期契約(Outright Forwards) ²	265,965	1,111,376	1,377,341	9.09
2.換匯(Fx Swaps)	4,804,381	4,065,409	8,869,790	58.55
3.換匯換利(Currency Swaps)	88,806	10,165	98,971	0.65
4.買入選擇權(Bought Options)	60,478	1,858,242	1,918,720	12.67
5.賣出選擇權(Sold Options)	56,749	1,812,675	1,869,424	12.34
(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)	-	-	-	-
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	423,666	18,828	442,494	2.92
(一)店頭市場(OTC)	79	1,333	1,412	0.01
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	423,587	17,495	441,082	2.91
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	791	39,015	39,806	0.26
(一)店頭市場(OTC)	-	14,359	14,359	0.09
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	791	24,656	25,447	0.17
小 計(一至四)	5,798,427	9,341,153	15,139,580	99.94
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	9,753	9,753	0.06
1.信用違約交換(Credit Default Swap)	-	9,753	9,753	0.06
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	5,798,427	9,350,906	15,149,333	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	104年1月		103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)	523,034	3.46	288,851	2.18	234,183	81.07
(一)店頭市場(OTC)	213,870	1.42	137,756	1.04	76,114	55.25
1. 遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-	-	-
2. 換利(IRS)	205,541	1.36	130,168	0.98	75,373	57.90
3. 買入選擇權(Bought Options)	943	0.01	686	0.01	257	37.46
4. 賣出選擇權(Sold Options)	7,386	0.05	6,902	0.05	484	7.01
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	309,164	2.04	151,095	1.14	158,069	104.62
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	160,217	1.06	64,612	0.49	95,605	147.97
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	148,947	0.98	86,483	0.65	62,464	72.23
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)	14,134,246	93.30	12,483,620	94.29	1,650,626	13.22
(一)店頭市場(OTC)	14,134,246	93.30	12,483,620	94.29	1,650,626	13.22
1. 遠期契約(Outright Forwards) ²	1,377,341	9.09	1,267,221	9.57	110,120	8.69
2. 換匯(Fx Swaps)	8,869,790	58.55	8,906,028	67.27	-36,238	-0.41
3. 換匯換利(Currency Swaps)	98,971	0.65	124,075	0.94	-25,104	-20.23
4. 買入選擇權(Bought Options)	1,918,720	12.67	1,123,693	8.49	795,027	70.75
5. 賣出選擇權(Sold Options)	1,869,424	12.34	1,062,603	8.02	806,821	75.93
(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)	442,494	2.92	448,967	3.39	-6,473	-1.44
(一)店頭市場(OTC)	1,412	0.01	326	-	1,086	333.13
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	441,082	2.91	448,641	3.39	-7,559	-1.68
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	39,806	0.26	14,026	0.11	25,780	183.80
(一)店頭市場(OTC)	14,359	0.09	5,371	0.04	8,988	167.34
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	25,447	0.17	8,655	0.07	16,792	194.02
小 計(一至四)	15,139,580	99.94	13,235,464	99.97	1,904,116	14.39
五、信用有關契約(Credit Contracts)	9,753	0.06	4,208	0.03	5,545	131.77
1. 信用違約交換(Credit Default Swap)	9,753	0.06	4,208	0.03	5,545	131.77
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	15,149,333	100.00	13,239,672	100.00	1,909,661	14.42

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。

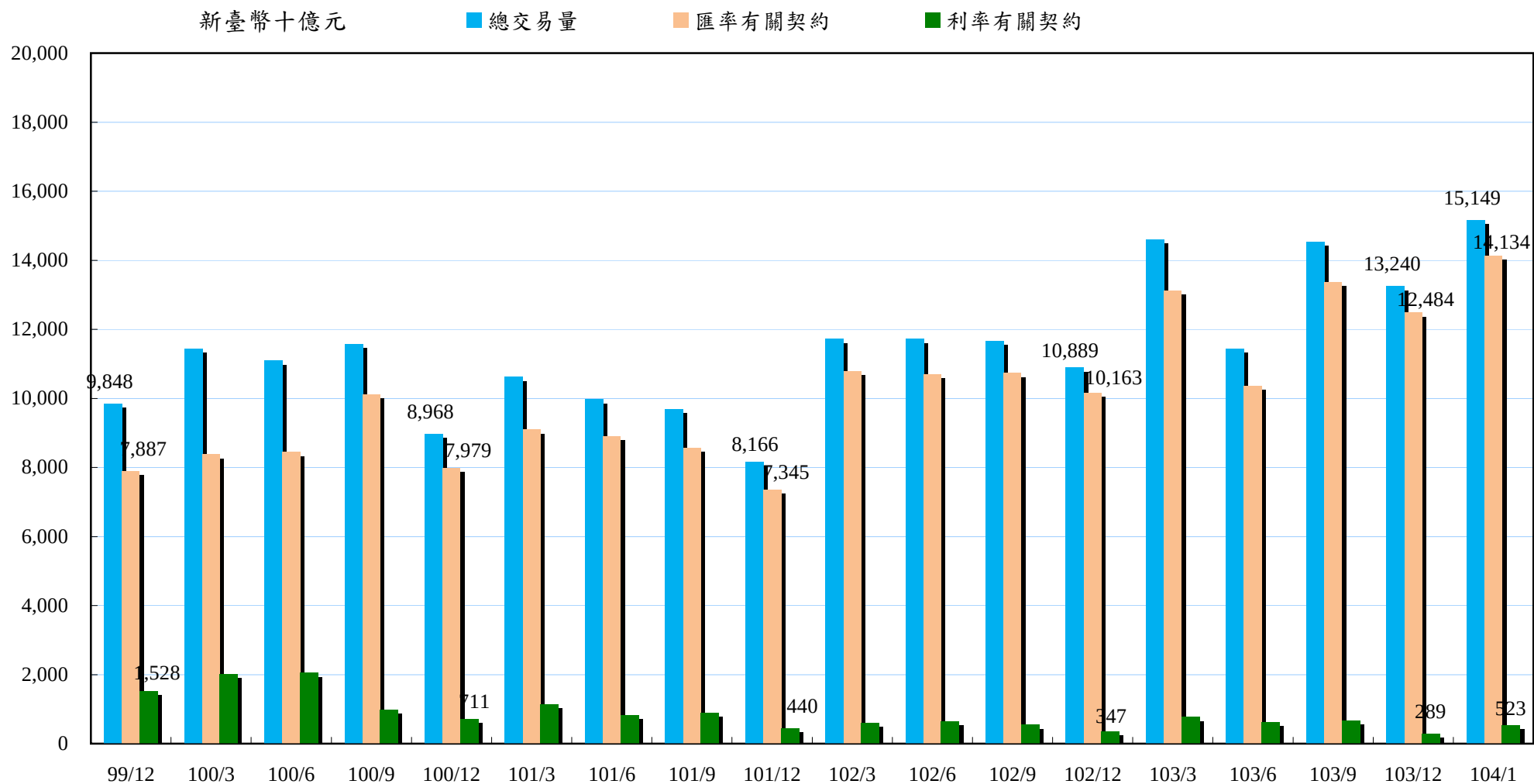
2. 「匯率有關—遠期契約」中「涉及新臺幣交易」金額包括新臺幣對外幣無本金交割遠期外匯交易；「純外幣交易」金額包括外幣保證金交易以遠期契約承作者。

附表3 銀行衍生性金融商品交易幣別比較表

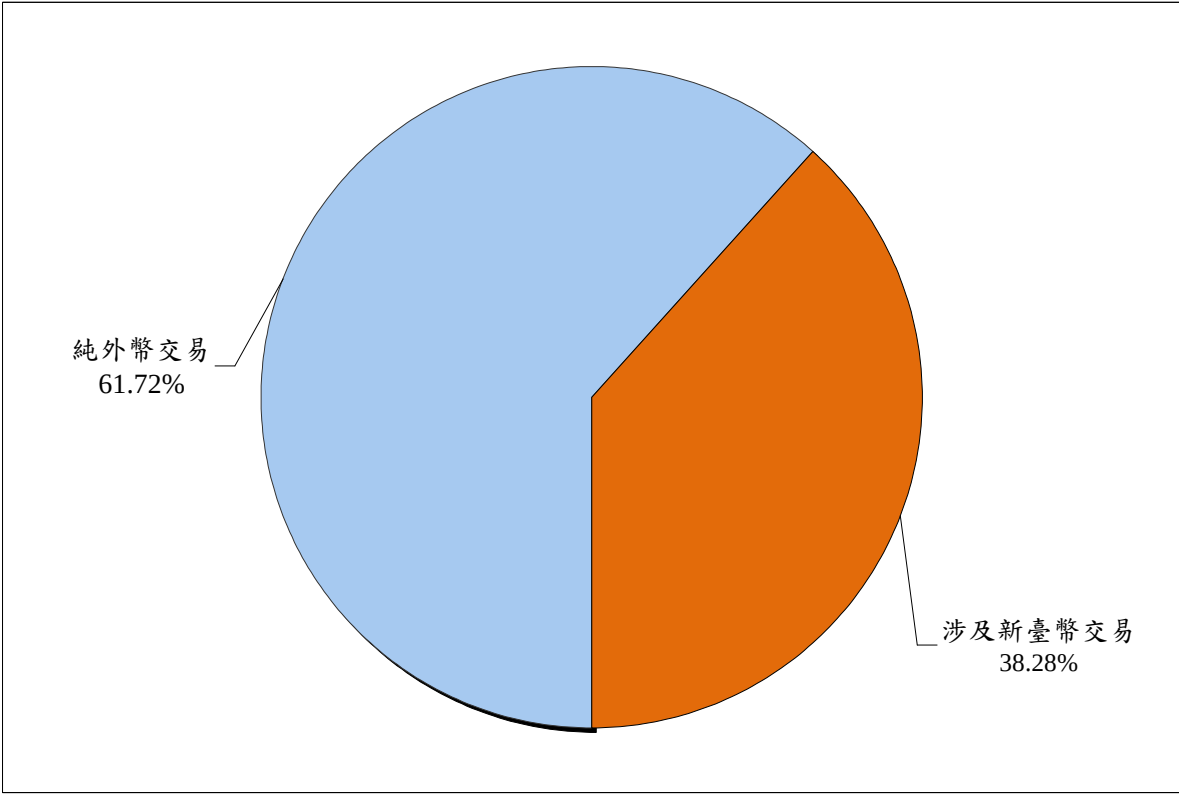
單位：新臺幣百萬元；%

商 品 種 類	104年1月		103年12月		比較增減	
	金額	比重	金額	比重	差 額	變動率
涉及新臺幣交易量	5,798,427	38.28	5,621,209	42.46	177,218	3.15
一、利率有關契約(Interest Rate Contracts)	97,591	0.64	58,680	0.44	38,911	66.31
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	5,276,379	34.83	5,121,577	38.68	154,802	3.02
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	423,666	2.80	439,873	3.33	-16,207	-3.68
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	791	0.01	1,079	0.01	-288	-26.69
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	-	-	-	-	-
六、其他有關契約(Other Contracts)	-	-	-	-	-	-
純外幣交易量	9,350,906	61.72	7,618,463	57.54	1,732,443	22.74
一、利率有關契約(Interest Rate Contracts)	425,443	2.81	230,171	1.74	195,272	84.84
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	8,857,867	58.47	7,362,043	55.60	1,495,824	20.32
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	18,828	0.12	9,094	0.07	9,734	107.04
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	39,015	0.26	12,947	0.10	26,068	201.34
五、信用有關契約(Credit Contracts)	9,753	0.06	4,208	0.03	5,545	131.77
六、其他有關契約(Other Contracts)	-	-	-	-	-	-
總 計	15,149,333	100.00	13,239,672	100.00	1,909,661	14.42

附圖1 銀行辦理衍生性金融商品交易量統計



附圖2 104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

