

附表1 銀行衍生性金融商品交易量彙總表

102年10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)	86,681	399,659	486,340	4.08
(一)店頭市場(OTC)	86,681	48,266	134,947	1.13
1. 遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-
2. 換利(IRS)	80,789	40,785	121,574	1.02
3. 買入選擇權(Bought Options)	4,110	6,024	10,134	0.08
4. 賣出選擇權(Sold Options)	1,782	1,457	3,239	0.03
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	351,393	351,393	2.95
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	-	175,042	175,042	1.47
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	-	176,351	176,351	1.48
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)	4,817,046	6,250,515	11,067,561	92.99
(一)店頭市場(OTC)	4,817,046	6,250,515	11,067,561	92.99
1. 遠期契約(Outright Forwards) ²	338,089	579,525	917,614	7.71
2. 換匯(Fx Swaps)	4,352,010	2,868,094	7,220,104	60.66
3. 換匯換利(Currency Swaps)	68,174	8,631	76,805	0.65
4. 買入選擇權(Bought Options)	30,906	1,381,130	1,412,036	11.86
5. 賣出選擇權(Sold Options)	27,867	1,413,135	1,441,002	12.11
(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)	315,172	10,423	325,595	2.73
(一)店頭市場(OTC)	52	2,890	2,942	0.02
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	315,120	7,533	322,653	2.71
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	1,448	22,253	23,701	0.20
(一)店頭市場(OTC)	-	11,938	11,938	0.10
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	1,448	10,315	11,763	0.10
小 計(一至四)	5,220,347	6,682,850	11,903,197	100.00
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	349	349	-
1. 信用違約交換(Credit Default Swap)	-	349	349	-
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	5,220,347	6,683,199	11,903,546	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

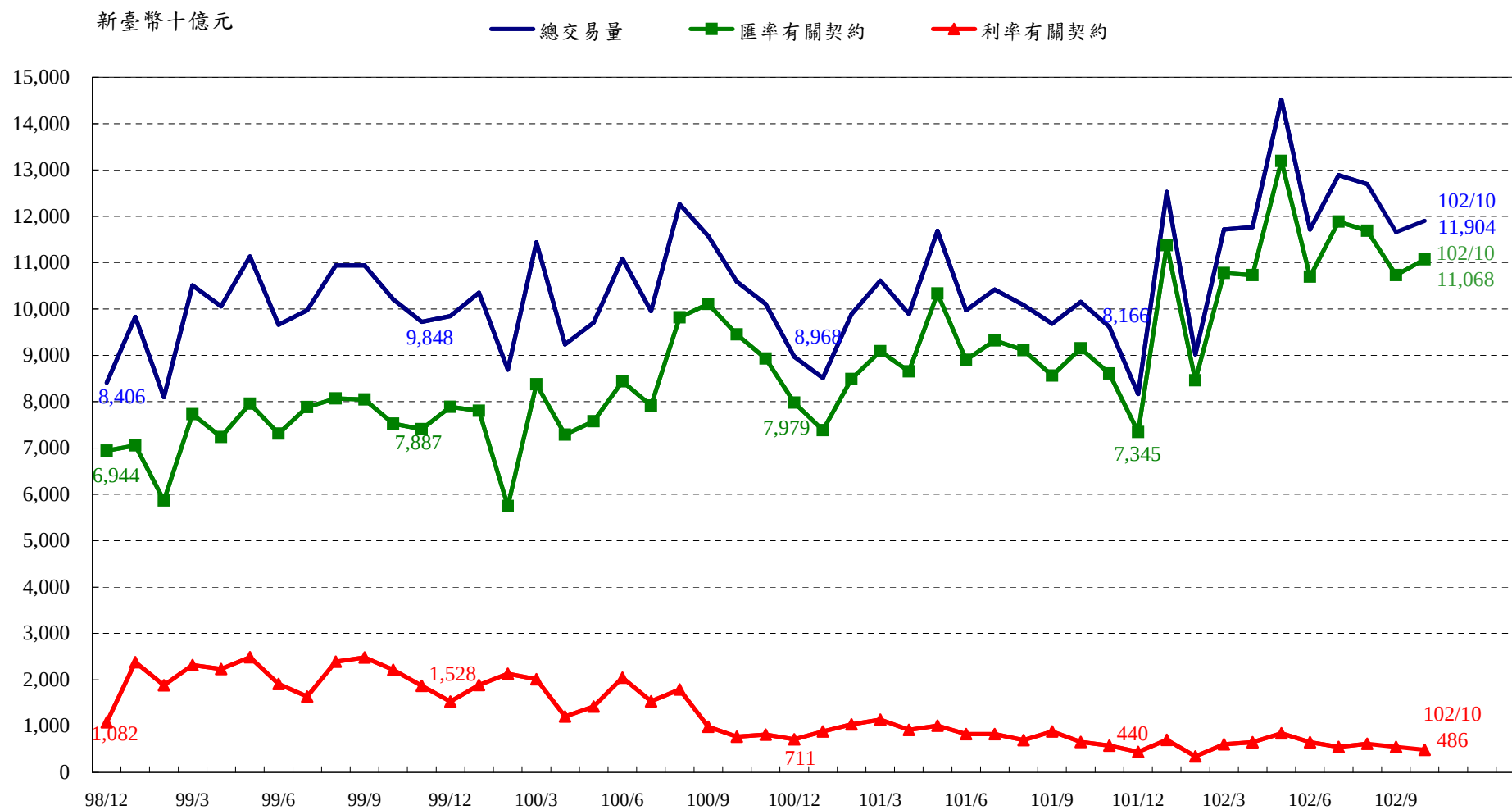
單位：新臺幣百萬元；%

商 品 種 類	102年10月		102年9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)	486,340	4.08	547,766	4.70	-61,426	-11.21
(一)店頭市場(OTC)	134,947	1.13	178,435	1.53	-43,488	-24.37
1. 遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-	-	-
2. 換利(IRS)	121,574	1.02	172,590	1.48	-51,016	-29.56
3. 買入選擇權(Bought Options)	10,134	0.08	269	0.00	9,865	3,667.29
4. 賣出選擇權(Sold Options)	3,239	0.03	5,576	0.05	-2,337	-41.91
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	351,393	2.95	369,331	3.17	-17,938	-4.86
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	175,042	1.47	179,104	1.54	-4,062	-2.27
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	176,351	1.48	190,227	1.63	-13,876	-7.29
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)	11,067,561	92.99	10,727,910	92.03	339,651	3.17
(一)店頭市場(OTC)	11,067,561	92.99	10,727,910	92.03	339,651	3.17
1. 遠期契約(Outright Forwards) ²	917,614	7.71	940,885	8.07	-23,271	-2.47
2. 換匯(Fx Swaps)	7,220,104	60.66	6,604,317	56.66	615,787	9.32
3. 換匯換利(Currency Swaps)	76,805	0.65	52,993	0.45	23,812	44.93
4. 買入選擇權(Bought Options)	1,412,036	11.86	1,558,474	13.37	-146,438	-9.40
5. 賣出選擇權(Sold Options)	1,441,002	12.11	1,571,241	13.48	-130,239	-8.29
(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)	325,595	2.73	359,006	3.08	-33,411	-9.31
(一)店頭市場(OTC)	2,942	0.02	3,030	0.03	-88	-2.90
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	322,653	2.71	355,976	3.05	-33,323	-9.36
四、商品有關契約 (Commodity Contracts)	23,701	0.20	19,763	0.17	3,938	19.93
(一)店頭市場(OTC)	11,938	0.10	9,657	0.08	2,281	23.62
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	11,763	0.10	10,106	0.09	1,657	16.40
小 計(一至四)	11,903,197	100.00	11,654,445	99.98	248,752	2.13
五、信用有關契約 (Credit Contracts)	349	-	1,902	0.02	-1,553	-81.65
1. 信用違約交換(Credit Default Swap)	349	-	1,902	0.02	-1,553	-81.65
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	11,903,546	100.00	11,656,347	100.00	247,199	2.12

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。

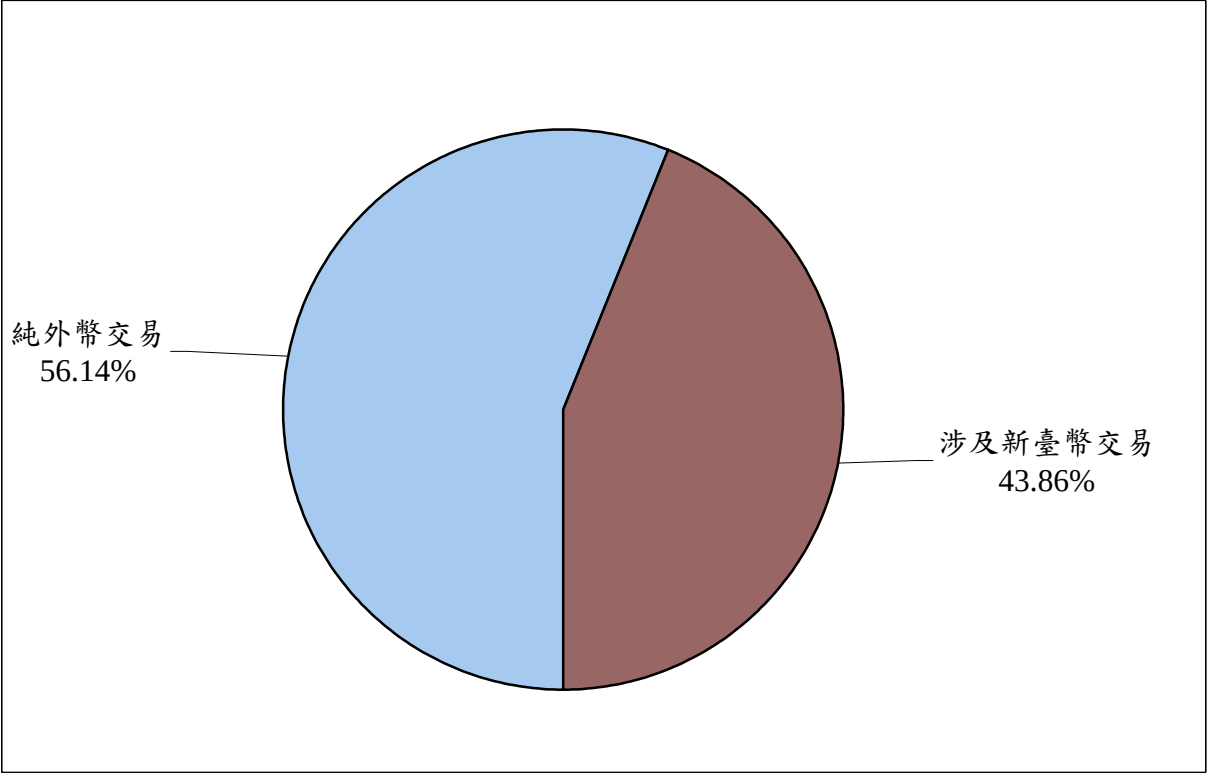
2. 「匯率有關—遠期契約」中「涉及新臺幣交易」金額包括新臺幣對外幣無本金交割遠期外匯交易；「純外幣交易」金額包括外幣保證金交易以遠期契約承作者。

附圖1 102年10月銀行辦理衍生性金融商品交易量統計



附圖2 102年10月銀行衍生性金融商品交易量內容分析

幣別



銀行類別

