

附表1 銀行衍生性金融商品交易量彙總表

103年2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)	94,789	346,418	441,207	3.23
(一)店頭市場(OTC)	94,789	36,779	131,568	0.97
1.遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-
2.換利(IRS)	92,818	34,338	127,156	0.93
3.買入選擇權(Bought Options)	692	152	844	0.01
4.賣出選擇權(Sold Options)	1,279	2,289	3,568	0.03
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	309,639	309,639	2.26
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	-	142,406	142,406	1.04
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	-	167,233	167,233	1.22
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)	4,769,084	8,012,655	12,781,739	93.57
(一)店頭市場(OTC)	4,769,084	8,012,655	12,781,739	93.57
1.遠期契約(Outright Forwards) ²	285,402	724,085	1,009,487	7.39
2.換匯(Fx Swaps)	4,346,439	3,130,409	7,476,848	54.74
3.換匯換利(Currency Swaps)	79,185	8,485	87,670	0.64
4.買入選擇權(Bought Options)	29,735	2,011,300	2,041,035	14.94
5.賣出選擇權(Sold Options)	28,323	2,138,376	2,166,699	15.86
(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)	384,236	6,394	390,630	2.86
(一)店頭市場(OTC)	3,794	555	4,349	0.03
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	380,442	5,839	386,281	2.83
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	1,069	43,433	44,502	0.33
(一)店頭市場(OTC)	-	10,688	10,688	0.08
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	1,069	32,745	33,814	0.25
小 計(一至四)	5,249,178	8,408,900	13,658,078	99.99
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	1,503	1,503	0.01
1.信用違約交換(Credit Default Swap)	-	1,503	1,503	0.01
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	5,249,178	8,410,403	13,659,581	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

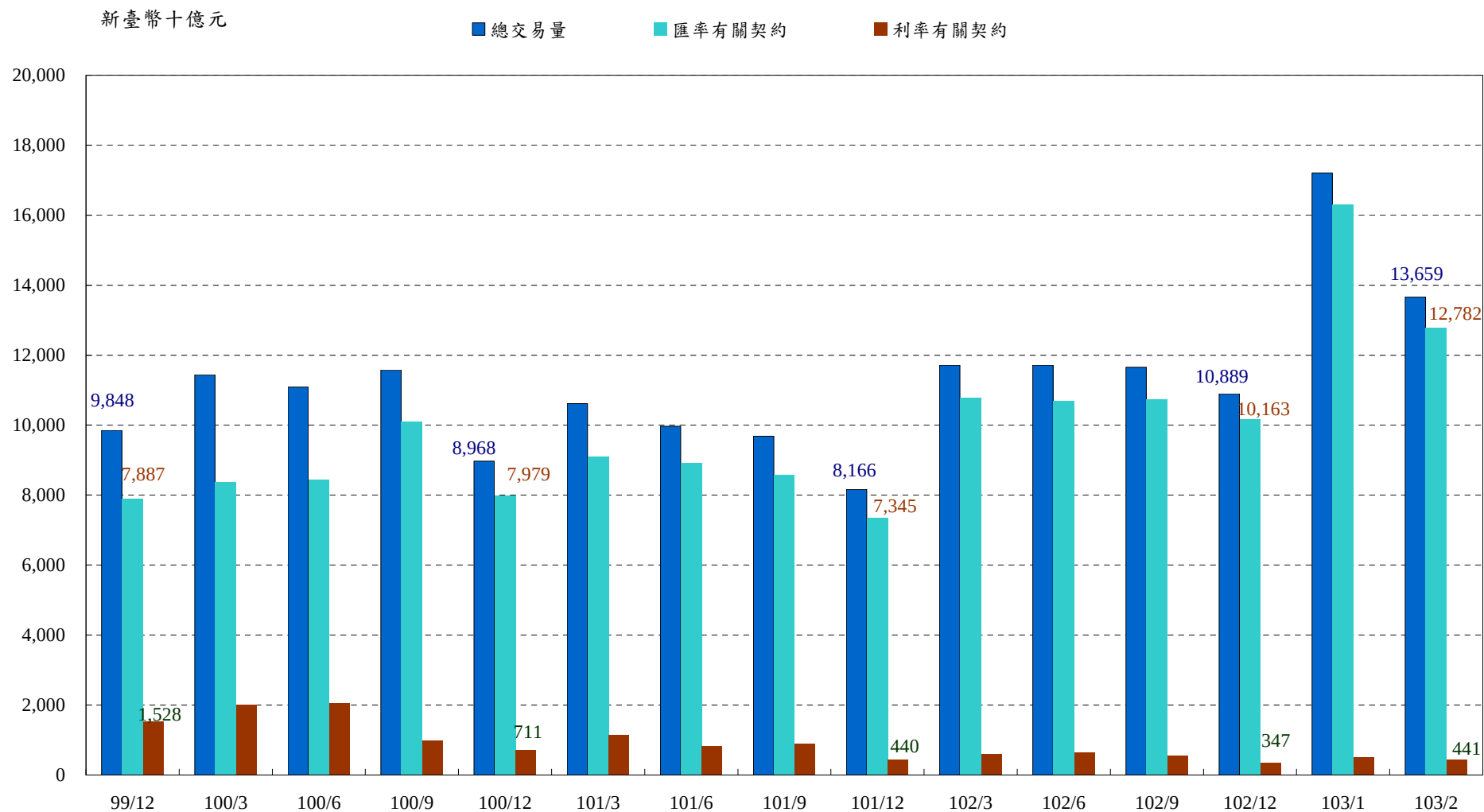
單位：新臺幣百萬元；%

商 品 種 類	103年2月		103年1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)	441,207	3.23	500,675	2.91	-59,468	-11.88
(一)店頭市場(OTC)	131,568	0.97	181,918	1.06	-50,350	-27.68
1. 遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-	-	-
2. 換利(IRS)	127,156	0.93	174,091	1.01	-46,935	-26.96
3. 買入選擇權(Bought Options)	844	0.01	2,072	0.01	-1,228	-59.27
4. 賣出選擇權(Sold Options)	3,568	0.03	5,755	0.04	-2,187	-38.00
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	309,639	2.26	318,757	1.85	-9,118	-2.86
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	142,406	1.04	157,938	0.92	-15,532	-9.83
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	167,233	1.22	160,819	0.93	6,414	3.99
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)	12,781,739	93.57	16,306,900	94.78	-3,525,161	-21.62
(一)店頭市場(OTC)	12,781,739	93.57	16,306,900	94.78	-3,525,161	-21.62
1. 遠期契約(Outright Forwards) ²	1,009,487	7.39	1,078,926	6.27	-69,439	-6.44
2. 換匯(Fx Swaps)	7,476,848	54.74	7,933,447	46.11	-456,599	-5.76
3. 換匯換利(Currency Swaps)	87,670	0.64	58,283	0.34	29,387	50.42
4. 買入選擇權(Bought Options)	2,041,035	14.94	3,515,736	20.43	-1,474,701	-41.95
5. 賣出選擇權(Sold Options)	2,166,699	15.86	3,720,508	21.63	-1,553,809	-41.76
(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)	390,630	2.86	368,630	2.14	22,000	5.97
(一)店頭市場(OTC)	4,349	0.03	7,524	0.04	-3,175	-42.20
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	386,281	2.83	361,106	2.10	25,175	6.97
四、商品有關契約 (Commodity Contracts)	44,502	0.33	23,287	0.14	21,215	91.10
(一)店頭市場(OTC)	10,688	0.08	12,460	0.07	-1,772	-14.22
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	33,814	0.25	10,827	0.07	22,987	212.31
小 計(一至四)	13,658,078	99.99	17,199,492	99.97	-3,541,414	-20.59
五、信用有關契約 (Credit Contracts)	1,503	0.01	5,671	0.03	-4,168	-73.50
1. 信用違約交換(Credit Default Swap)	1,503	0.01	5,671	0.03	-4,168	-73.50
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	13,659,581	100.00	17,205,163	100.00	-3,545,582	-20.61

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。

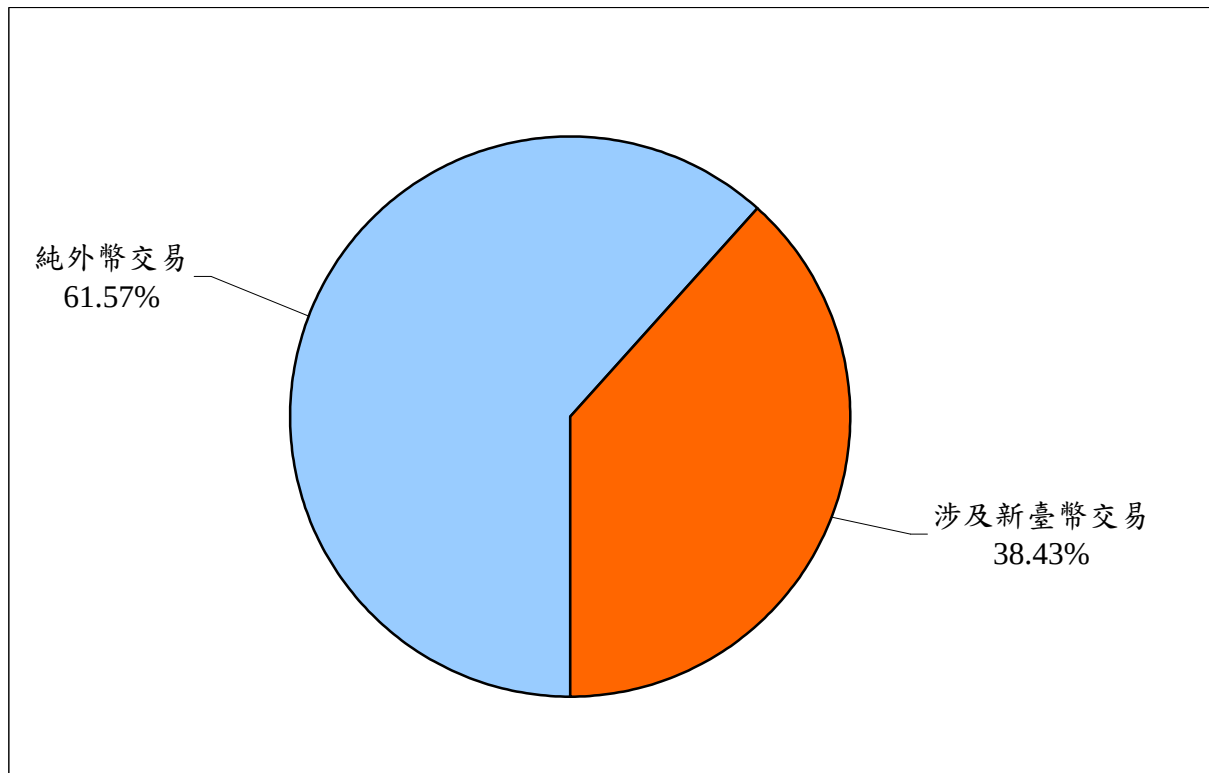
2. 「匯率有關—遠期契約」中「涉及新臺幣交易」金額包括新臺幣對外幣無本金交割遠期外匯交易；「純外幣交易」金額包括外幣保證金交易以遠期契約承作者。

附圖1 103年2月銀行辦理衍生性金融商品交易量統計



附圖2 103年2月銀行衍生性金融商品交易量內容分析

幣別



銀行類別

