

附表1 銀行衍生性金融商品交易量彙總表

102年8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)	147,477	472,017	619,494	4.88
(一)店頭市場(OTC)	147,477	54,551	202,028	1.59
1.遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-
2.換利(IRS)	140,289	48,799	189,088	1.49
3.買入選擇權(Bought Options)	2,147	-	2,147	0.02
4.賣出選擇權(Sold Options)	5,041	5,752	10,793	0.08
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	417,466	417,466	3.29
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	-	200,523	200,523	1.58
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	-	216,943	216,943	1.71
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)	4,379,025	7,310,736	11,689,761	92.08
(一)店頭市場(OTC)	4,379,025	7,310,736	11,689,761	92.08
1.遠期契約(Outright Forwards) ²	249,963	693,581	943,544	7.43
2.換匯(Fx Swaps)	4,000,750	3,800,003	7,800,753	61.44
3.換匯換利(Currency Swaps)	71,997	3,582	75,579	0.60
4.買入選擇權(Bought Options)	28,305	1,396,904	1,425,209	11.23
5.賣出選擇權(Sold Options)	28,010	1,416,666	1,444,676	11.38
(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)	329,718	22,289	352,007	2.77
(一)店頭市場(OTC)	675	5,096	5,771	0.04
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	329,043	17,193	346,236	2.73
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	2,442	30,046	32,488	0.26
(一)店頭市場(OTC)	-	12,113	12,113	0.10
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	2,442	17,933	20,375	0.16
小 計(一至四)	4,858,662	7,835,088	12,693,750	99.99
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	1,681	1,681	0.01
1.信用違約交換(Credit Default Swap)	-	1,681	1,681	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	4,858,662	7,836,769	12,695,431	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

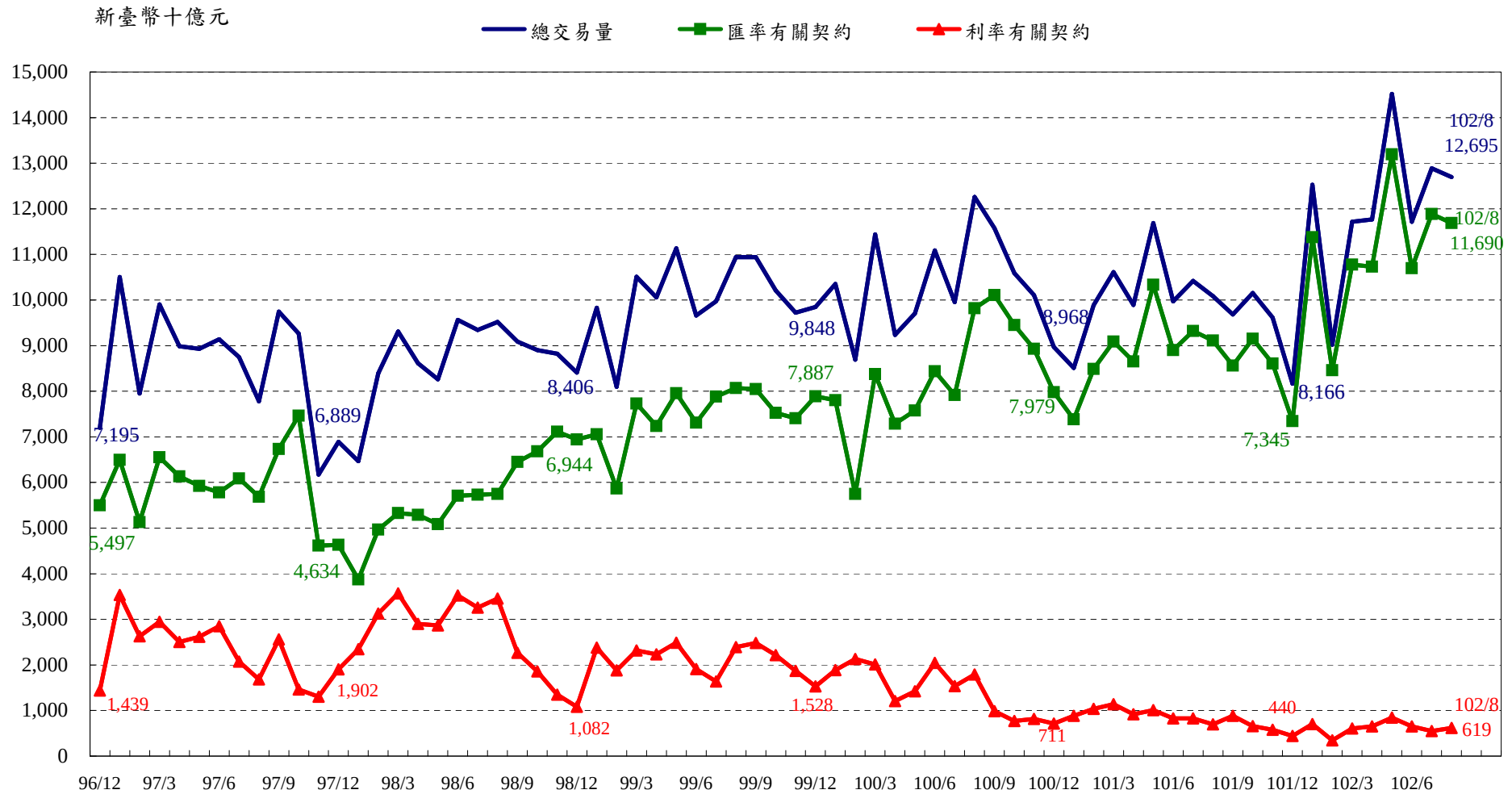
單位：新臺幣百萬元；%

商 品 種 類	102年8月		102年7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)	619,494	4.88	550,857	4.27	68,637	12.46
(一)店頭市場(OTC)	202,028	1.59	215,481	1.67	-13,453	-6.24
1. 遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-	-	-
2. 換利(IRS)	189,088	1.49	201,995	1.56	-12,907	-6.39
3. 買入選擇權(Bought Options)	2,147	0.02	2,302	0.02	-155	-6.73
4. 賣出選擇權(Sold Options)	10,793	0.08	11,184	0.09	-391	-3.50
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	417,466	3.29	335,376	2.60	82,090	24.48
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	200,523	1.58	163,612	1.27	36,911	22.56
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	216,943	1.71	171,764	1.33	45,179	26.30
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)	11,689,761	92.08	11,883,155	92.19	-193,394	-1.63
(一)店頭市場(OTC)	11,689,761	92.08	11,883,155	92.19	-193,394	-1.63
1. 遠期契約(Outright Forwards) ²	943,544	7.43	925,343	7.18	18,201	1.97
2. 換匯(Fx Swaps)	7,800,753	61.44	8,162,063	63.32	-361,310	-4.43
3. 換匯換利(Currency Swaps)	75,579	0.60	120,499	0.93	-44,920	-37.28
4. 買入選擇權(Bought Options)	1,425,209	11.23	1,339,985	10.40	85,224	6.36
5. 賣出選擇權(Sold Options)	1,444,676	11.38	1,335,265	10.36	109,411	8.19
(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)	352,007	2.77	424,312	3.29	-72,305	-17.04
(一)店頭市場(OTC)	5,771	0.04	5,564	0.04	207	3.72
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	346,236	2.73	418,748	3.25	-72,512	-17.32
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	32,488	0.26	29,307	0.23	3,181	10.85
(一)店頭市場(OTC)	12,113	0.10	16,469	0.13	-4,356	-26.45
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	20,375	0.16	12,838	0.10	7,537	58.71
小 計(一至四)	12,693,750	99.99	12,887,631	99.98	-193,881	-1.50
五、信用有關契約(Credit Contracts)	1,681	0.01	2,873	0.02	-1,192	-41.49
1. 信用違約交換(Credit Default Swap)	1,681	0.01	2,873	0.02	-1,192	-41.49
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	12,695,431	100.00	12,890,504	100.00	-195,073	-1.51

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。

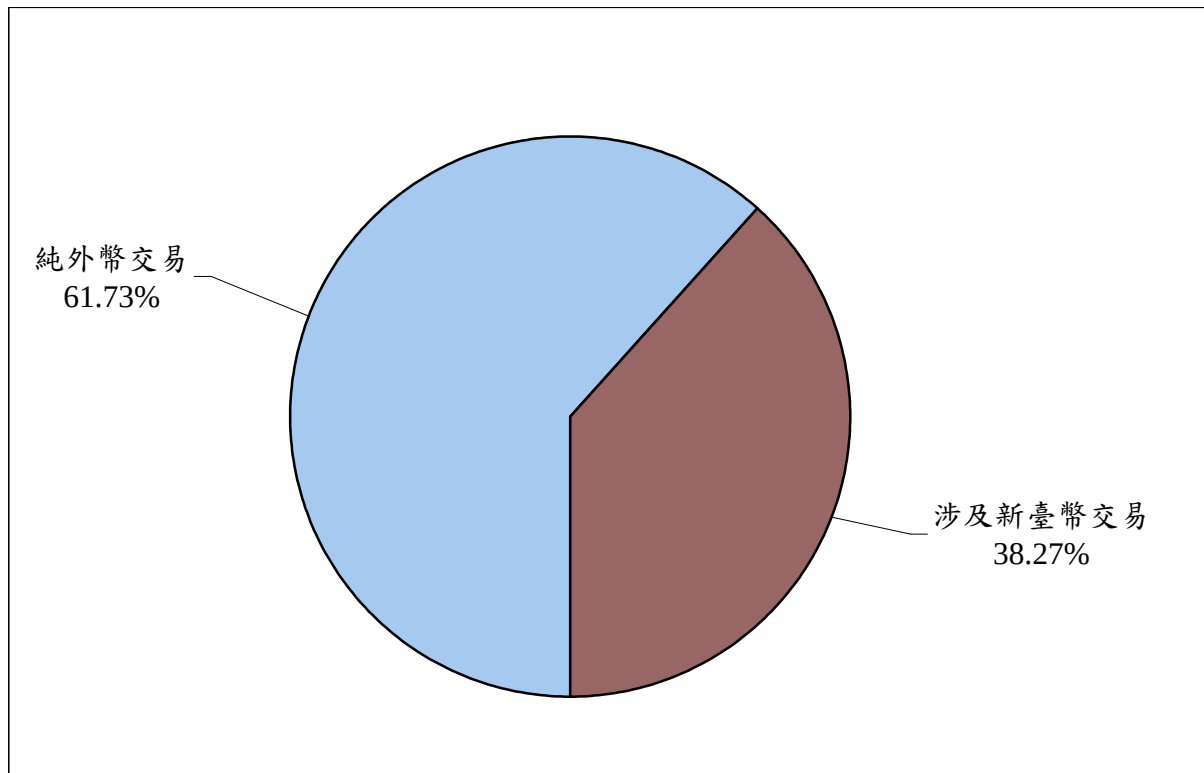
2. 「匯率有關—遠期契約」中「涉及新臺幣交易」金額包括新臺幣對外幣無本金交割遠期外匯交易；「純外幣交易」金額包括外幣保證金交易以遠期契約承作者。

附圖1 102年8月銀行辦理衍生性金融商品交易量統計



附圖2 102年8月銀行衍生性金融商品交易量內容分析

幣別



銀行類別

