

附表1 銀行衍生性金融商品交易量彙總表

103年3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)	107, 436	663, 743	771, 179	5. 29
(一)店頭市場(OTC)	107, 436	53, 800	161, 236	1. 11
1. 遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-
2. 換利(IRS)	103, 412	47, 788	151, 200	1. 04
3. 買入選擇權(Bought Options)	1, 187	-	1, 187	0. 01
4. 賣出選擇權(Sold Options)	2, 837	6, 012	8, 849	0. 06
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	609, 943	609, 943	4. 18
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	-	286, 135	286, 135	1. 96
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	-	323, 808	323, 808	2. 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)	5, 455, 022	7, 658, 997	13, 114, 019	89. 82
(一)店頭市場(OTC)	5, 455, 022	7, 658, 997	13, 114, 019	89. 82
1. 遠期契約(Outright Forwards) ²	286, 519	839, 324	1, 125, 843	7. 71
2. 換匯(Fx Swaps)	5, 005, 942	4, 155, 394	9, 161, 336	62. 75
3. 換匯換利(Currency Swaps)	89, 303	17, 018	106, 321	0. 73
4. 買入選擇權(Bought Options)	38, 076	1, 282, 605	1, 320, 681	9. 04
5. 賣出選擇權(Sold Options)	35, 182	1, 364, 656	1, 399, 838	9. 59
(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)	566, 988	13, 577	580, 565	3. 98
(一)店頭市場(OTC)	3, 715	585	4, 300	0. 03
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	563, 273	12, 992	576, 265	3. 95
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	707	130, 545	131, 252	0. 89
(一)店頭市場(OTC)	-	9, 442	9, 442	0. 06
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	707	121, 103	121, 810	0. 83
小 計(一至四)	6, 130, 153	8, 466, 862	14, 597, 015	99. 98
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	2, 930	2, 930	0. 02
1. 信用違約交換(Credit Default Swap)	-	2, 930	2, 930	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)	-	-	-	-
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	6, 130, 153	8, 469, 792	14, 599, 945	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

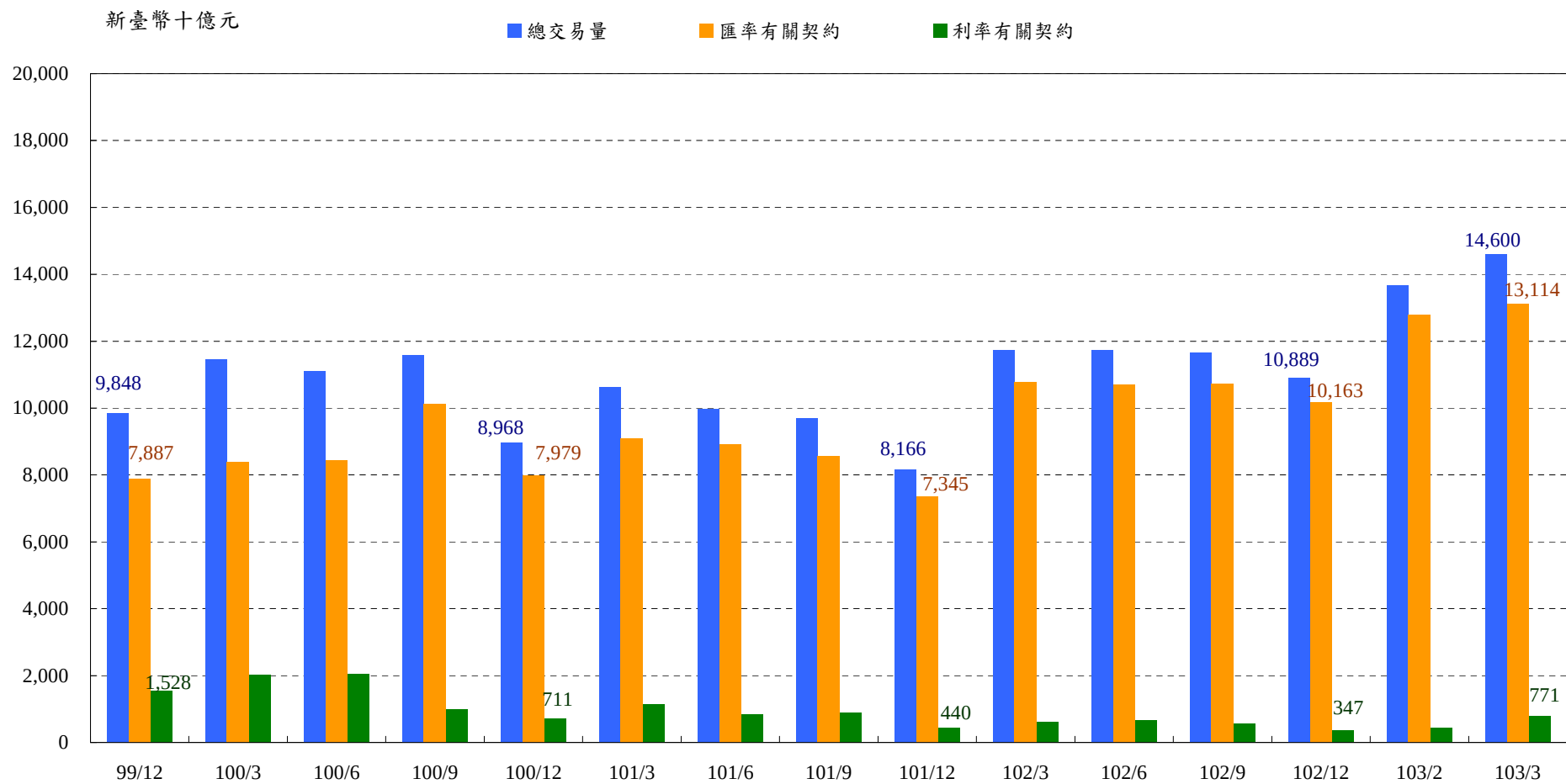
單位：新臺幣百萬元；%

商 品 種 類	103年3月		103年2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)	771,179	5.29	441,207	3.23	329,972	74.79
(一)店頭市場(OTC)	161,236	1.11	131,568	0.97	29,668	22.55
1. 遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-	-	-
2. 換利(IRS)	151,200	1.04	127,156	0.93	24,044	18.91
3. 買入選擇權(Bought Options)	1,187	0.01	844	0.01	343	40.64
4. 賣出選擇權(Sold Options)	8,849	0.06	3,568	0.03	5,281	148.01
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	609,943	4.18	309,639	2.26	300,304	96.99
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	286,135	1.96	142,406	1.04	143,729	100.93
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	323,808	2.22	167,233	1.22	156,575	93.63
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)	13,114,019	89.82	12,781,739	93.57	332,280	2.60
(一)店頭市場(OTC)	13,114,019	89.82	12,781,739	93.57	332,280	2.60
1. 遠期契約(Outright Forwards) ²	1,125,843	7.71	1,009,487	7.39	116,356	11.53
2. 換匯(Fx Swaps)	9,161,336	62.75	7,476,848	54.74	1,684,488	22.53
3. 換匯換利(Currency Swaps)	106,321	0.73	87,670	0.64	18,651	21.27
4. 買入選擇權(Bought Options)	1,320,681	9.04	2,041,035	14.94	-720,354	-35.29
5. 賣出選擇權(Sold Options)	1,399,838	9.59	2,166,699	15.86	-766,861	-35.39
(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)	580,565	3.98	390,630	2.86	189,935	48.62
(一)店頭市場(OTC)	4,300	0.03	4,349	0.03	-49	-1.13
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	576,265	3.95	386,281	2.83	189,984	49.18
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	131,252	0.89	44,502	0.33	86,750	194.94
(一)店頭市場(OTC)	9,442	0.06	10,688	0.08	-1,246	-11.66
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	121,810	0.83	33,814	0.25	87,996	260.24
小 計(一至四)	14,597,015	99.98	13,658,078	99.99	938,937	6.87
五、信用有關契約(Credit Contracts)	2,930	0.02	1,503	0.01	1,427	94.94
1. 信用違約交換(Credit Default Swap)	2,930	0.02	1,503	0.01	1,427	94.94
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	14,599,945	100.00	13,659,581	100.00	940,364	6.88

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。

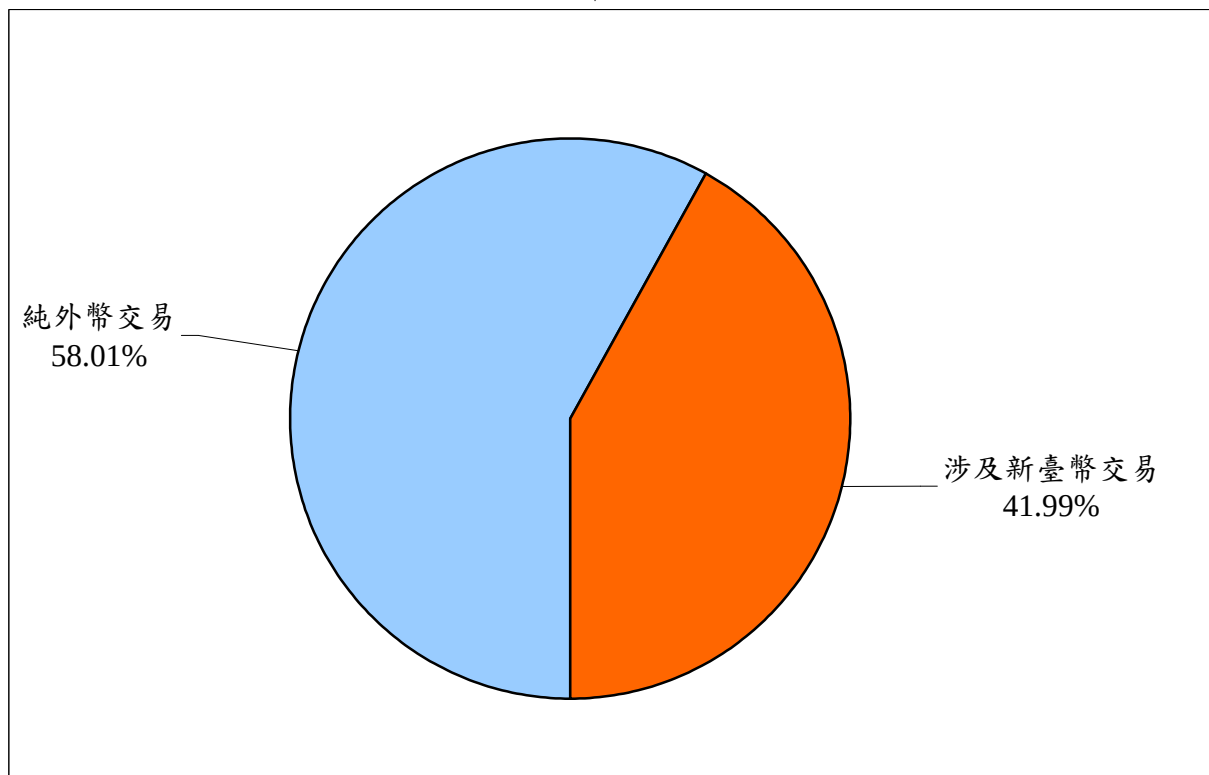
2. 「匯率有關—遠期契約」中「涉及新臺幣交易」金額包括新臺幣對外幣無本金交割遠期外匯交易；「純外幣交易」金額包括外幣保證金交易以遠期契約承作者。

附圖1 103年3月銀行辦理衍生性金融商品交易量統計



附圖2 103年3月銀行衍生性金融商品交易量內容分析

幣別



銀行類別

