

附表1 銀行衍生性金融商品交易量彙總表

103年6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)	119,090	500,957	620,047	5.43
(一)店頭市場(OTC)	119,090	59,834	178,924	1.57
1.遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-
2.換利(IRS)	115,188	56,257	171,445	1.50
3.買入選擇權(Bought Options)	804	-	804	0.01
4.賣出選擇權(Sold Options)	3,098	3,577	6,675	0.06
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	441,123	441,123	3.86
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	-	198,437	198,437	1.74
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	-	215,763	215,763	1.89
3.買入選擇權(Bought Options)	-	11,966	11,966	0.10
4.賣出選擇權(Sold Options)	-	14,957	14,957	0.13
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	4,572,502	5,792,125	10,364,627	90.66
(一)店頭市場(OTC)	4,572,502	5,792,125	10,364,627	90.66
1.遠期契約(Outright Forwards) ²	268,657	561,638	830,295	7.26
2.換匯(Fx Swaps)	4,145,736	3,764,603	7,910,339	69.19
3.換匯換利(Currency Swaps)	97,488	13,875	111,363	0.98
4.買入選擇權(Bought Options)	31,337	730,973	762,310	6.67
5.賣出選擇權(Sold Options)	29,284	721,036	750,320	6.56
(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)	384,374	5,807	390,181	3.41
(一)店頭市場(OTC)	15,845	2,524	18,369	0.16
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	368,529	3,283	371,812	3.25
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	1,173	54,811	55,984	0.49
(一)店頭市場(OTC)	-	8,168	8,168	0.07
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	1,173	46,643	47,816	0.42
小 計(一至四)	5,077,139	6,353,700	11,430,839	99.99
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	1,529	1,529	0.01
1.信用違約交換(Credit Default Swap)	-	1,529	1,529	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	5,077,139	6,355,229	11,432,368	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

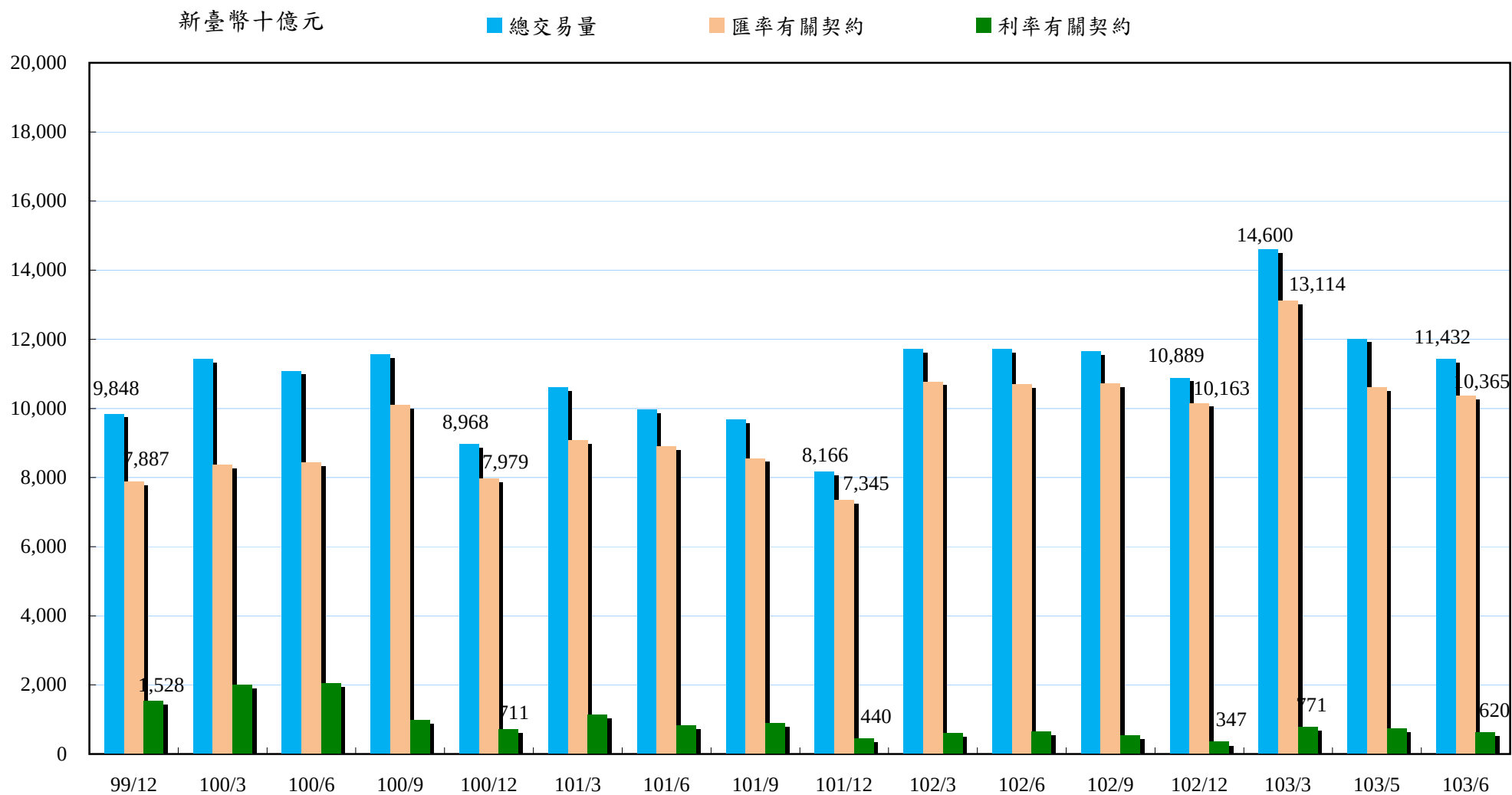
單位：新臺幣百萬元；%

商 品 種 類	103年6月		103年5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)	620,047	5.43	748,472	6.23	-128,425	-17.16
(一)店頭市場(OTC)	178,924	1.57	146,559	1.22	32,365	22.08
1. 遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-	-	-
2. 換利(IRS)	171,445	1.50	140,013	1.16	31,432	22.45
3. 買入選擇權(Bought Options)	804	0.01	933	0.01	-129	-13.83
4. 賣出選擇權(Sold Options)	6,675	0.06	5,613	0.05	1,062	18.92
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	441,123	3.86	601,913	5.01	-160,790	-26.71
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	198,437	1.74	292,658	2.44	-94,221	-32.19
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	215,763	1.89	291,225	2.42	-75,462	-25.91
3. 買入選擇權(Bought Options)	11,966	0.10	12,020	0.10	-54	-0.45
4. 賣出選擇權(Sold Options)	14,957	0.13	6,010	0.05	8,947	148.87
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	10,364,627	90.66	10,624,448	88.39	-259,821	-2.45
(一)店頭市場(OTC)	10,364,627	90.66	10,624,448	88.39	-259,821	-2.45
1. 遠期契約(Outright Forwards) ²	830,295	7.26	917,157	7.63	-86,862	-9.47
2. 換匯(Fx Swaps)	7,910,339	69.19	8,336,176	69.35	-425,837	-5.11
3. 換匯換利(Currency Swaps)	111,363	0.98	103,025	0.86	8,338	8.09
4. 買入選擇權(Bought Options)	762,310	6.67	625,725	5.21	136,585	21.83
5. 賣出選擇權(Sold Options)	750,320	6.56	642,365	5.34	107,955	16.81
(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)	390,181	3.41	556,745	4.63	-166,564	-29.92
(一)店頭市場(OTC)	18,369	0.16	5,785	0.05	12,584	217.53
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	371,812	3.25	550,960	4.58	-179,148	-32.52
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	55,984	0.49	88,197	0.73	-32,213	-36.52
(一)店頭市場(OTC)	8,168	0.07	12,363	0.10	-4,195	-33.93
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	47,816	0.42	75,834	0.63	-28,018	-36.95
小 計(一至四)	11,430,839	99.99	12,017,862	99.98	-587,023	-4.88
五、信用有關契約(Credit Contracts)	1,529	0.01	2,580	0.02	-1,051	-40.74
1. 信用違約交換(Credit Default Swap)	1,529	0.01	2,580	0.02	-1,051	-40.74
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	11,432,368	100.00	12,020,442	100.00	-588,074	-4.89

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。

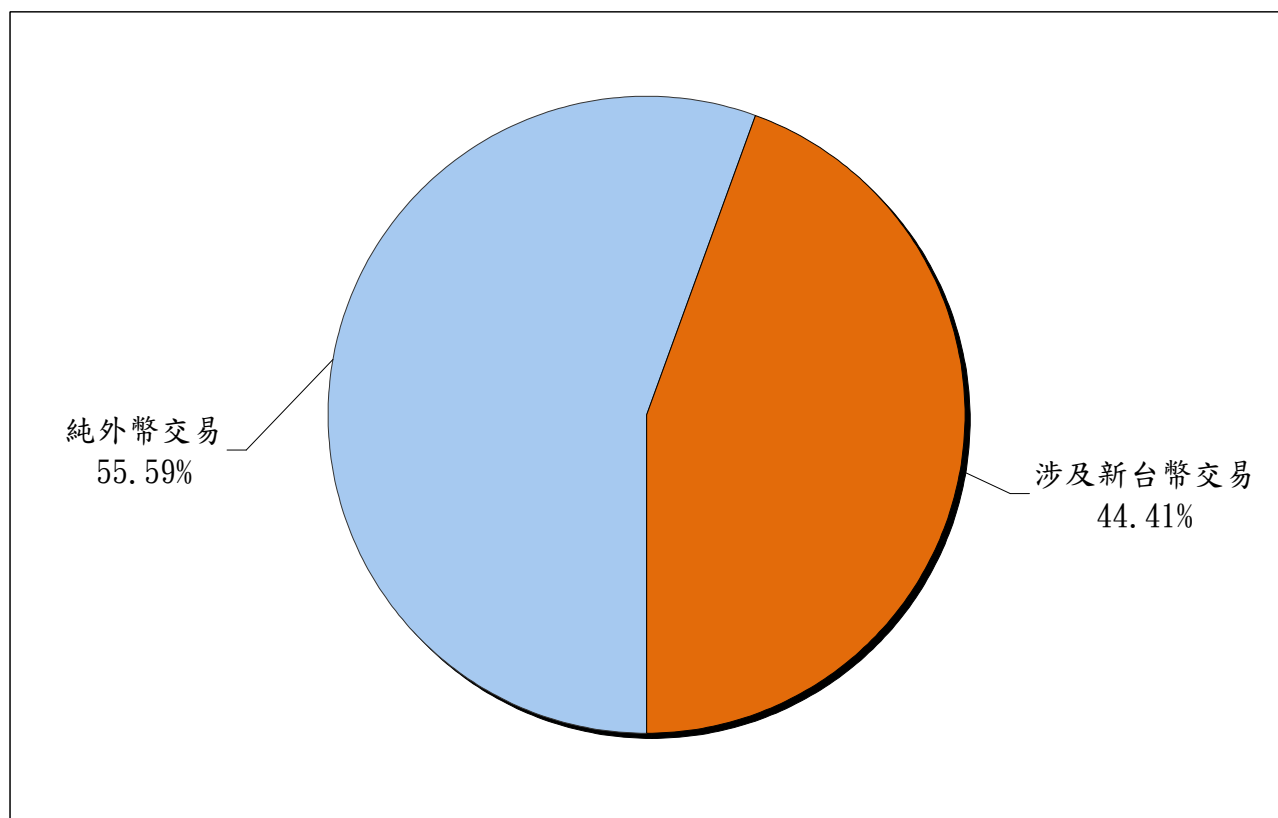
2. 「匯率有關—遠期契約」中「涉及新臺幣交易」金額包括新臺幣對外幣無本金交割遠期外匯交易；「純外幣交易」金額包括外幣保證金交易以遠期契約承作者。

附圖1 銀行辦理衍生性金融商品交易量統計



附圖2 103年6月銀行衍生性金融商品交易量內容分析

幣別



銀行類別

