

**附表1 銀行衍生性金融商品交易量彙總表**

102年4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 <sup>1</sup> |           |            |        |
|------------------------------------------------|----------------------------|-----------|------------|--------|
|                                                | 涉及新臺幣交易                    | 純外幣交易     | 合 計        | 比重     |
| <b>一、利率有關契約(Interest Rate Contracts)</b>       | 158,234                    | 494,159   | 652,393    | 5.54   |
| (一)店頭市場(OTC)                                   | 158,234                    | 71,154    | 229,388    | 1.95   |
| 1.遠期利率協議(FRA)                                  | -                          | -         | -          | -      |
| 2.換利(IRS)                                      | 146,665                    | 62,505    | 209,170    | 1.78   |
| 3.買入選擇權(Bought Options)                        | 7,600                      | 1,344     | 8,944      | 0.08   |
| 4.賣出選擇權(Sold Options)                          | 3,969                      | 7,305     | 11,274     | 0.09   |
| (二)交易所(Exchange-traded Contracts)              | -                          | 423,005   | 423,005    | 3.59   |
| 1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)             | -                          | 199,206   | 199,206    | 1.69   |
| 2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)            | -                          | 223,799   | 223,799    | 1.90   |
| 3.買入選擇權(Bought Options)                        | -                          | -         | -          | -      |
| 4.賣出選擇權(Sold Options)                          | -                          | -         | -          | -      |
| <b>二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)</b> | 4,254,626                  | 6,474,292 | 10,728,918 | 91.17  |
| (一)店頭市場(OTC)                                   | 4,254,626                  | 6,474,292 | 10,728,918 | 91.17  |
| 1.遠期契約(Outright Forwards) <sup>2</sup>         | 357,573                    | 688,062   | 1,045,635  | 8.89   |
| 2.換匯(Fx Swaps)                                 | 3,677,612                  | 3,232,986 | 6,910,598  | 58.72  |
| 3.換匯換利(Currency Swaps)                         | 145,802                    | 2,175     | 147,977    | 1.26   |
| 4.買入選擇權(Bought Options)                        | 37,547                     | 1,283,834 | 1,321,381  | 11.23  |
| 5.賣出選擇權(Sold Options)                          | 36,092                     | 1,267,235 | 1,303,327  | 11.07  |
| (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)                          | -                          | -         | -          | -      |
| <b>三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)</b>     | 338,876                    | 14,321    | 353,197    | 3.00   |
| (一)店頭市場(OTC)                                   | 471                        | 4,721     | 5,192      | 0.04   |
| (二)交易所(Exchange-traded Contracts)              | 338,405                    | 9,600     | 348,005    | 2.96   |
| <b>四、商品有關契約(Commodity Contracts)</b>           | 2,660                      | 28,751    | 31,411     | 0.27   |
| (一)店頭市場(OTC)                                   | -                          | 15,028    | 15,028     | 0.13   |
| (二)交易所(Exchange-traded Contracts)              | 2,660                      | 13,723    | 16,383     | 0.14   |
| <b>小 計(一至四)</b>                                | 4,754,396                  | 7,011,523 | 11,765,919 | 99.98  |
| <b>五、信用有關契約(Credit Contracts)</b>              | -                          | 2,642     | 2,642      | 0.02   |
| 1.信用違約交換(Credit Default Swap)                  | -                          | 2,642     | 2,642      | 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)                                    | -                          | -         | -          | -      |
| <b>六、其他有關契約(Other Contracts)</b>               | -                          | -         | -          | -      |
| 1.遠期契約(Outright Forwards)                      | -                          | -         | -          | -      |
| 2.交換(Swaps)                                    | -                          | -         | -          | -      |
| 3.選擇權(Options)                                 | -                          | -         | -          | -      |
| <b>總 計</b>                                     | 4,754,396                  | 7,014,165 | 11,768,561 | 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4月            |               | 102年3月            |               | 比較增減           |               |
|------------------------------------------------|-------------------|---------------|-------------------|---------------|----------------|---------------|
|                                                | 合 計 <sup>1</sup>  | 比重            | 合 計               | 比重            | 合 計            | 變動率           |
| <b>一、利率有關契約(Interest Rate Contracts)</b>       | <b>652,393</b>    | <b>5.54</b>   | <b>606,026</b>    | <b>5.17</b>   | <b>46,367</b>  | <b>7.65</b>   |
| (一)店頭市場(OTC)                                   | 229,388           | 1.95          | 232,923           | 1.99          | -3,535         | -1.52         |
| 1. 遠期利率協議(FRA)                                 | -                 | -             | -                 | -             | -              | -             |
| 2. 換利(IRS)                                     | 209,170           | 1.78          | 215,102           | 1.84          | -5,932         | -2.76         |
| 3. 買入選擇權(Bought Options)                       | 8,944             | 0.08          | 3,099             | 0.03          | 5,845          | 188.61        |
| 4. 賣出選擇權(Sold Options)                         | 11,274            | 0.09          | 14,722            | 0.12          | -3,448         | -23.42        |
| (二)交易所(Exchange-traded Contracts)              | 423,005           | 3.59          | 373,103           | 3.18          | 49,902         | 13.37         |
| 1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)            | 199,206           | 1.69          | 195,047           | 1.66          | 4,159          | 2.13          |
| 2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)           | 223,799           | 1.90          | 178,056           | 1.52          | 45,743         | 25.69         |
| 3. 買入選擇權(Bought Options)                       | -                 | -             | -                 | -             | -              | -             |
| 4. 賣出選擇權(Sold Options)                         | -                 | -             | -                 | -             | -              | -             |
| <b>二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)</b> | <b>10,728,918</b> | <b>91.17</b>  | <b>10,776,315</b> | <b>92.00</b>  | <b>-47,397</b> | <b>-0.44</b>  |
| (一)店頭市場(OTC)                                   | 10,728,918        | 91.17         | 10,776,315        | 92.00         | -47,397        | -0.44         |
| 1. 遠期契約(Outright Forwards) <sup>2</sup>        | 1,045,635         | 8.89          | 885,274           | 7.56          | 160,361        | 18.11         |
| 2. 換匯(Fx Swaps)                                | 6,910,598         | 58.72         | 7,229,817         | 61.72         | -319,219       | -4.42         |
| 3. 換匯換利(Currency Swaps)                        | 147,977           | 1.26          | 77,041            | 0.66          | 70,936         | 92.08         |
| 4. 買入選擇權(Bought Options)                       | 1,321,381         | 11.23         | 1,290,612         | 11.02         | 30,769         | 2.38          |
| 5. 賣出選擇權(Sold Options)                         | 1,303,327         | 11.07         | 1,293,571         | 11.04         | 9,756          | 0.75          |
| (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)                         | -                 | -             | -                 | -             | -              | -             |
| <b>三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)</b>     | <b>353,197</b>    | <b>3.00</b>   | <b>299,265</b>    | <b>2.56</b>   | <b>53,932</b>  | <b>18.02</b>  |
| (一)店頭市場(OTC)                                   | 5,192             | 0.04          | 3,000             | 0.03          | 2,192          | 73.07         |
| (二)交易所(Exchange-traded Contracts)              | 348,005           | 2.96          | 296,265           | 2.53          | 51,740         | 17.46         |
| <b>四、商品有關契約(Commodity Contracts)</b>           | <b>31,411</b>     | <b>0.27</b>   | <b>28,147</b>     | <b>0.24</b>   | <b>3,264</b>   | <b>11.60</b>  |
| (一)店頭市場(OTC)                                   | 15,028            | 0.13          | 19,633            | 0.17          | -4,605         | -23.46        |
| (二)交易所(Exchange-traded Contracts)              | 16,383            | 0.14          | 8,514             | 0.07          | 7,869          | 92.42         |
| <b>小 計(一至四)</b>                                | <b>11,765,919</b> | <b>99.98</b>  | <b>11,709,753</b> | <b>99.97</b>  | <b>56,166</b>  | <b>0.48</b>   |
| <b>五、信用有關契約(Credit Contracts)</b>              | <b>2,642</b>      | <b>0.02</b>   | <b>3,946</b>      | <b>0.03</b>   | <b>-1,304</b>  | <b>-33.05</b> |
| 1. 信用違約交換(Credit Default Swap)                 | 2,642             | 0.02          | 3,946             | 0.03          | -1,304         | -33.05        |
| 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)                                   | -                 | -             | -                 | -             | -              | -             |
| <b>六、其他有關契約(Other Contracts)</b>               | <b>-</b>          | <b>-</b>      | <b>-</b>          | <b>-</b>      | <b>-</b>       | <b>-</b>      |
| 1. 遠期契約(Outright Forwards)                     | -                 | -             | -                 | -             | -              | -             |
| 2. 交換(Swaps)                                   | -                 | -             | -                 | -             | -              | -             |
| 3. 選擇權(Options)                                | -                 | -             | -                 | -             | -              | -             |
| <b>總 計</b>                                     | <b>11,768,561</b> | <b>100.00</b> | <b>11,713,699</b> | <b>100.00</b> | <b>54,862</b>  | <b>0.47</b>   |

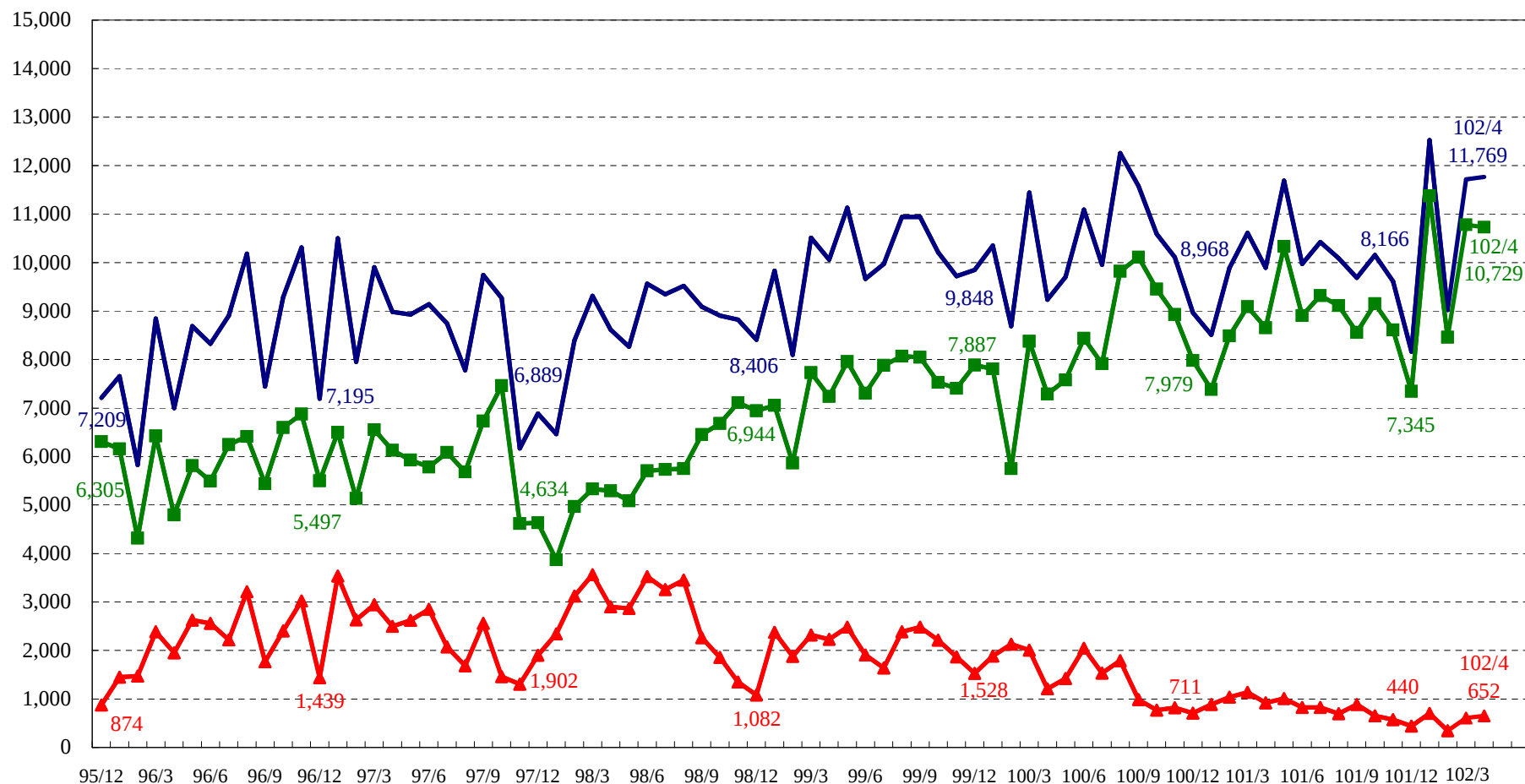
註：1. 包括國內總分支機構及國際金融業務分行資料，不含海外分行及子行；本表已剔除銀行間交易重複計算部分。

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4月銀行辦理衍生性金融商品交易量統計

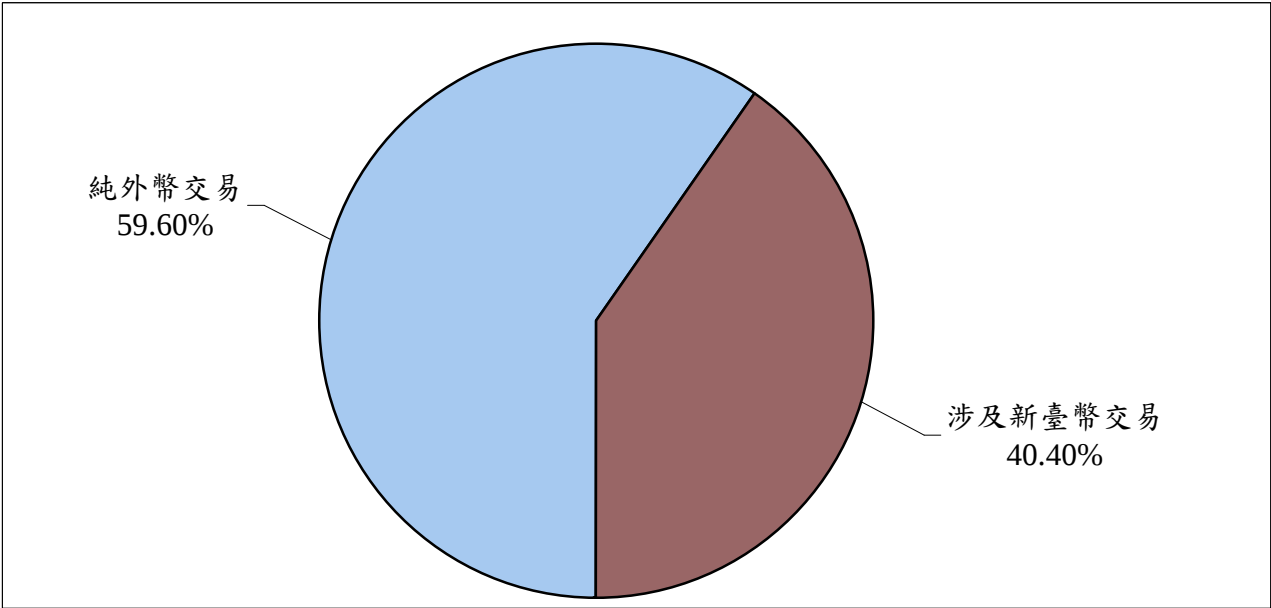
新臺幣十億元

— 總交易量      ■ 匯率有關契約      ▲ 利率有關契約



附圖2 102年4月銀行衍生性金融商品交易量內容分析

幣別



銀行類別

