

附表1 銀行衍生性金融商品交易量彙總表

102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)	174,657	431,369	606,026	5.17
(一)店頭市場(OTC)	174,657	58,266	232,923	1.99
1.遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-
2.換利(IRS)	167,377	47,725	215,102	1.84
3.買入選擇權(Bought Options)	3,000	99	3,099	0.03
4.賣出選擇權(Sold Options)	4,280	10,442	14,722	0.12
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	373,103	373,103	3.18
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	-	195,047	195,047	1.66
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	-	178,056	178,056	1.52
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)	4,396,352	6,379,963	10,776,315	92.00
(一)店頭市場(OTC)	4,396,352	6,379,963	10,776,315	92.00
1.遠期契約(Outright Forwards) ²	330,163	555,111	885,274	7.56
2.換匯(Fx Swaps)	3,913,101	3,316,716	7,229,817	61.72
3.換匯換利(Currency Swaps)	73,199	3,842	77,041	0.66
4.買入選擇權(Bought Options)	40,303	1,250,309	1,290,612	11.02
5.賣出選擇權(Sold Options)	39,586	1,253,985	1,293,571	11.04
(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)	289,263	10,002	299,265	2.56
(一)店頭市場(OTC)	926	2,074	3,000	0.03
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	288,337	7,928	296,265	2.53
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	1,005	27,142	28,147	0.24
(一)店頭市場(OTC)	-	19,633	19,633	0.17
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	1,005	7,509	8,514	0.07
小 計(一至四)	4,861,277	6,848,476	11,709,753	99.97
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	3,946	3,946	0.03
1.信用違約交換(Credit Default Swap)	-	3,946	3,946	0.03
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	4,861,277	6,852,422	11,713,699	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3月		102年2月		比較增減	
	合 計 ¹	比重	合 計	比重	合 計	變動率
一、利率有關契約(Interest Rate Contracts)	606,026	5.17	347,741	3.85	258,285	74.28
(一)店頭市場(OTC)	232,923	1.99	109,792	1.21	123,131	112.15
1. 遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-	-	-
2. 換利(IRS)	215,102	1.84	101,104	1.12	113,998	112.75
3. 買入選擇權(Bought Options)	3,099	0.03	1,022	0.01	2,077	203.23
4. 賣出選擇權(Sold Options)	14,722	0.12	7,666	0.08	7,056	92.04
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	373,103	3.18	237,949	2.64	135,154	56.80
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	195,047	1.66	115,582	1.28	79,465	68.75
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	178,056	1.52	122,367	1.36	55,689	45.51
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)	10,776,315	92.00	8,459,595	93.79	2,316,720	27.39
(一)店頭市場(OTC)	10,776,315	92.00	8,459,595	93.79	2,316,720	27.39
1. 遠期契約(Outright Forwards) ²	885,274	7.56	755,588	8.38	129,686	17.16
2. 換匯(Fx Swaps)	7,229,817	61.72	5,515,108	61.14	1,714,709	31.09
3. 換匯換利(Currency Swaps)	77,041	0.66	55,003	0.61	22,038	40.07
4. 買入選擇權(Bought Options)	1,290,612	11.02	1,060,953	11.76	229,659	21.65
5. 賣出選擇權(Sold Options)	1,293,571	11.04	1,072,943	11.90	220,628	20.56
(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)	299,265	2.56	190,699	2.11	108,566	56.93
(一)店頭市場(OTC)	3,000	0.03	3,853	0.04	-853	-22.14
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	296,265	2.53	186,846	2.07	109,419	58.56
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	28,147	0.24	20,676	0.23	7,471	36.13
(一)店頭市場(OTC)	19,633	0.17	16,260	0.18	3,373	20.74
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	8,514	0.07	4,416	0.05	4,098	92.80
小 計(一至四)	11,709,753	99.97	9,018,711	99.98	2,691,042	29.84
五、信用有關契約(Credit Contracts)	3,946	0.03	1,404	0.02	2,542	181.05
1. 信用違約交換(Credit Default Swap)	3,946	0.03	1,404	0.02	2,542	181.05
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)	-	-	-	-	-	-
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	11,713,699	100.00	9,020,115	100.00	2,693,584	29.86

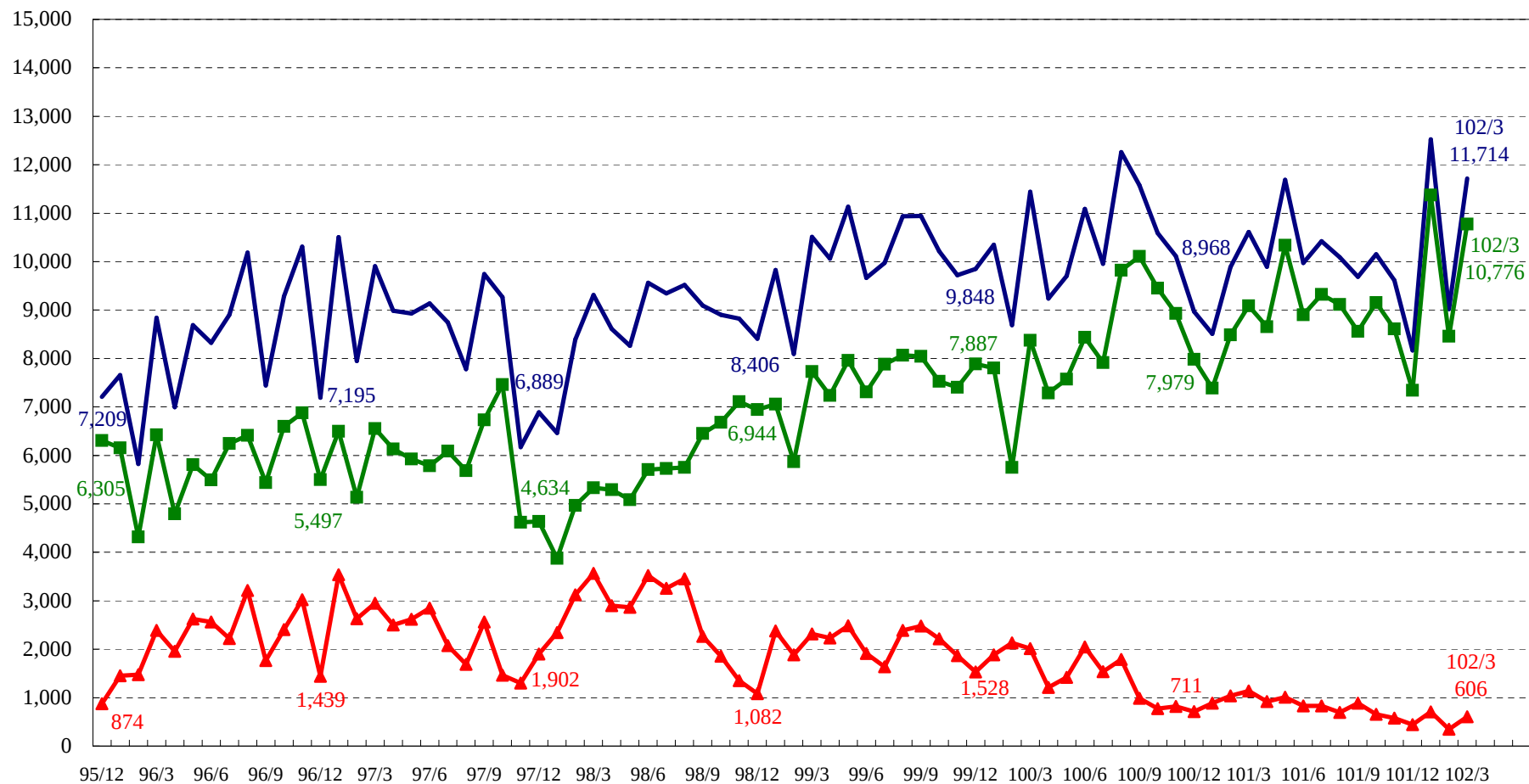
註：1. 包括國內總分支機構及國際金融業務分行資料，不含海外分行及子行；本表已剔除銀行間交易重複計算部分。

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3月銀行辦理衍生性金融商品交易量統計

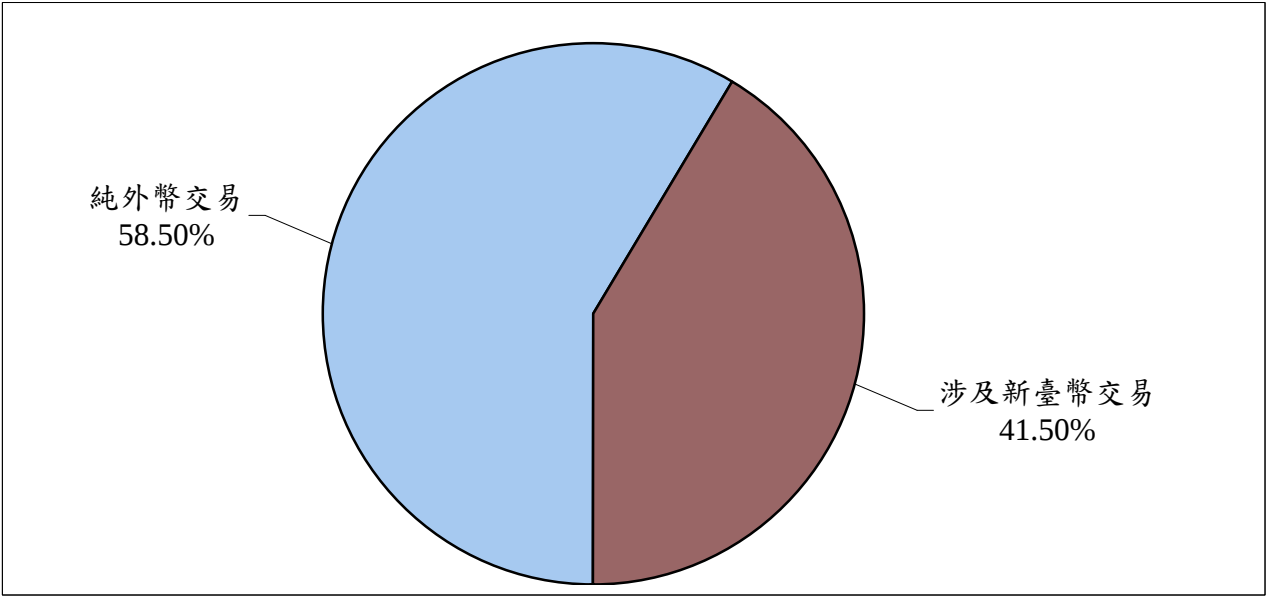
新臺幣十億元

— 總交易量 ■ 匯率有關契約 ▲ 利率有關契約



附圖2 102年3月銀行衍生性金融商品交易量內容分析

幣別



銀行類別

