

附表1 銀行衍生性金融商品交易量彙總表

103年11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)	22,798	418,739	441,537	3.44
(一)店頭市場(OTC)	22,798	160,945	183,743	1.43
1.遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-
2.換利(IRS)	20,270	152,545	172,815	1.35
3.買入選擇權(Bought Options)	730	-	730	0.00
4.賣出選擇權(Sold Options)	1,798	8,400	10,198	0.08
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	257,794	257,794	2.01
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	-	115,685	115,685	0.90
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	-	113,553	113,553	0.89
3.買入選擇權(Bought Options)	-	14,278	14,278	0.11
4.賣出選擇權(Sold Options)	-	14,278	14,278	0.11
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	4,821,890	7,225,524	12,047,414	93.92
(一)店頭市場(OTC)	4,821,890	7,225,524	12,047,414	93.92
1.遠期契約(Outright Forwards) ²	214,328	907,569	1,121,897	8.75
2.換匯(Fx Swaps)	4,458,171	3,739,103	8,197,274	63.90
3.換匯換利(Currency Swaps)	86,782	2,335	89,117	0.69
4.買入選擇權(Bought Options)	30,377	1,328,787	1,359,164	10.60
5.賣出選擇權(Sold Options)	32,232	1,247,730	1,279,962	9.98
(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)	309,616	8,979	318,595	2.48
(一)店頭市場(OTC)	970	482	1,452	0.01
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	308,646	8,497	317,143	2.47
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	646	16,055	16,701	0.13
(一)店頭市場(OTC)	-	6,322	6,322	0.05
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	646	9,733	10,379	0.08
小 計(一至四)	5,154,950	7,669,297	12,824,247	99.97
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	4,042	4,042	0.03
1.信用違約交換(Credit Default Swap)	-	4,042	4,042	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	5,154,950	7,673,339	12,828,289	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11月		103年10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)	441,537	3.44	640,597	4.58	-199,060	-31.07
(一)店頭市場(OTC)	183,743	1.43	140,784	1.00	42,959	30.51
1. 遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-	-	-
2. 換利(IRS)	172,815	1.35	123,641	0.88	49,174	39.77
3. 買入選擇權(Bought Options)	730	-	1,105	0.01	-375	-33.94
4. 賣出選擇權(Sold Options)	10,198	0.08	16,038	0.11	-5,840	-36.41
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	257,794	2.01	499,813	3.58	-242,019	-48.42
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	115,685	0.90	218,736	1.56	-103,051	-47.11
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	113,553	0.89	219,416	1.57	-105,863	-48.25
3. 買入選擇權(Bought Options)	14,278	0.11	37,131	0.27	-22,853	-61.55
4. 賣出選擇權(Sold Options)	14,278	0.11	24,530	0.18	-10,252	-41.79
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	12,047,414	93.92	12,836,457	91.78	-789,043	-6.15
(一)店頭市場(OTC)	12,047,414	93.92	12,836,457	91.78	-789,043	-6.15
1. 遠期契約(Outright Forwards) ²	1,121,897	8.75	1,205,430	8.62	-83,533	-6.93
2. 換匯(Fx Swaps)	8,197,274	63.90	9,176,269	65.61	-978,995	-10.67
3. 換匯換利(Currency Swaps)	89,117	0.69	107,850	0.77	-18,733	-17.37
4. 買入選擇權(Bought Options)	1,359,164	10.60	1,202,207	8.60	156,957	13.06
5. 賣出選擇權(Sold Options)	1,279,962	9.98	1,144,701	8.18	135,261	11.82
(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)	318,595	2.48	491,468	3.51	-172,873	-35.17
(一)店頭市場(OTC)	1,452	0.01	8,121	0.06	-6,669	-82.12
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	317,143	2.47	483,347	3.45	-166,204	-34.39
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	16,701	0.13	10,945	0.08	5,756	52.59
(一)店頭市場(OTC)	6,322	0.05	7,031	0.05	-709	-10.08
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	10,379	0.08	3,914	0.03	6,465	165.18
小計(一至四)	12,824,247	99.97	13,979,467	99.95	-1,155,220	-8.26
五、信用有關契約(Credit Contracts)	4,042	0.03	6,571	0.05	-2,529	-38.49
1. 信用違約交換(Credit Default Swap)	4,042	0.03	6,571	0.05	-2,529	-38.49
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	12,828,289	100.00	13,986,038	100.00	-1,157,749	-8.28

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3 銀行衍生性金融商品交易幣別比較表

單位：新臺幣百萬元；%

商 品 種 類	103年11月		103年10月		比較增減	
	金額	比重	金額	比重	差 額	變動率
涉及新臺幣交易量	5,154,950	40.18	5,764,807	41.22	-609,857	-10.58
一、利率有關契約(Interest Rate Contracts)	22,798	0.18	63,401	0.45	-40,603	-64.04
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	4,821,890	37.59	5,238,196	37.45	-416,306	-7.95
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	309,616	2.41	462,501	3.31	-152,885	-33.06
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	646	-	709	0.01	-63	-8.89
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	-	-	-	-	-
六、其他有關契約(Other Contracts)	-	-	-	-	-	-
純外幣交易量	7,673,339	59.82	8,221,231	58.78	-547,892	-6.66
一、利率有關契約(Interest Rate Contracts)	418,739	3.26	577,196	4.12	-158,457	-27.45
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	7,225,524	56.33	7,598,261	54.33	-372,737	-4.91
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	8,979	0.07	28,967	0.21	-19,988	-69.00
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	16,055	0.13	10,236	0.07	5,819	56.85
五、信用有關契約(Credit Contracts)	4,042	0.03	6,571	0.05	-2,529	-38.49
六、其他有關契約(Other Contracts)	-	-	-	-	-	-
總 計	12,828,289	100.00	13,986,038	100.00	-1,157,749	-8.28

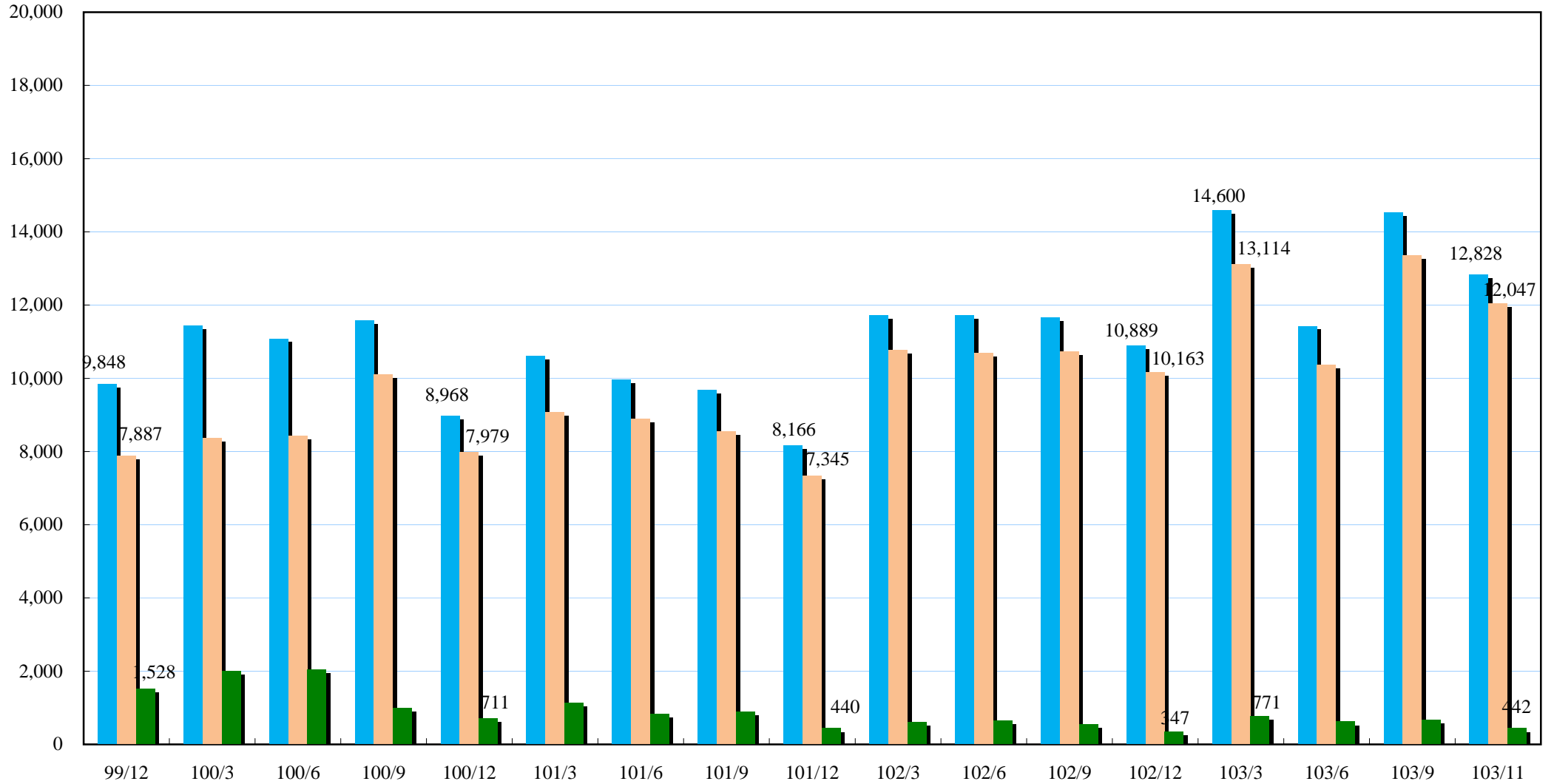
附圖1 銀行辦理衍生性金融商品交易量統計

新臺幣十億元

■ 總交易量

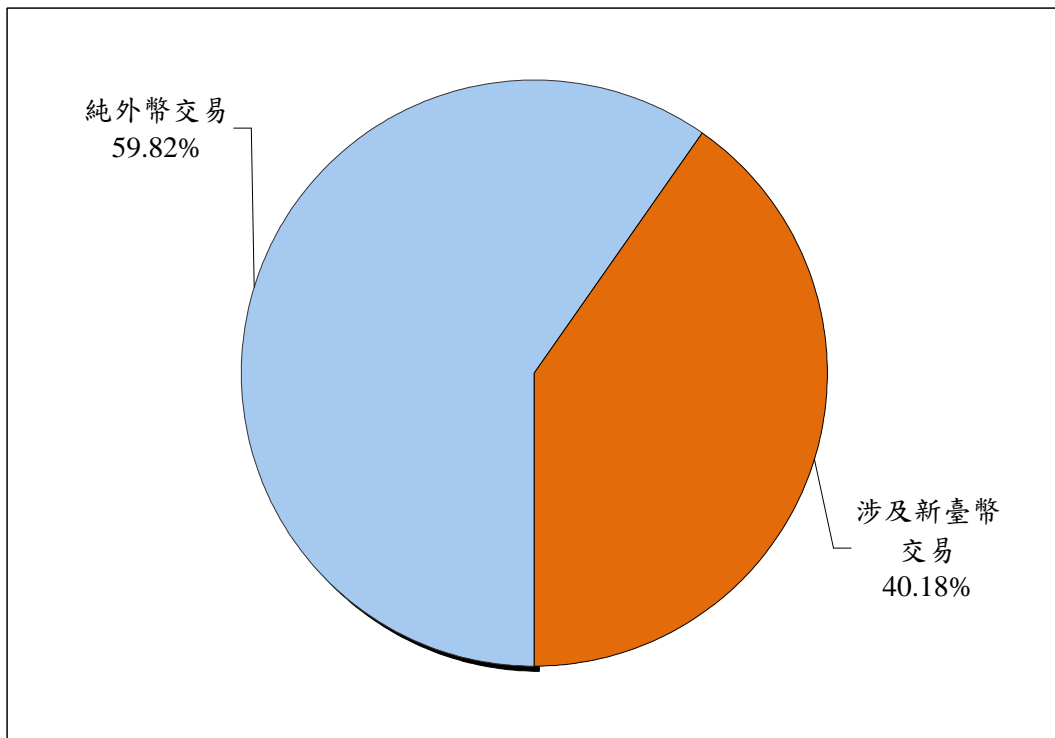
■ 匯率有關契約

■ 利率有關契約



附圖2 103年11月銀行衍生性金融商品交易量內容分析

幣別



銀行類別

