

附表1 銀行衍生性金融商品交易量彙總表

102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)	227,762	421,797	649,559	5.54
(一)店頭市場(OTC)	227,762	59,595	287,357	2.45
1.遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-
2.換利(IRS)	215,460	56,604	272,064	2.32
3.買入選擇權(Bought Options)	4,973	92	5,065	0.04
4.賣出選擇權(Sold Options)	7,329	2,899	10,228	0.09
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	362,202	362,202	3.09
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	-	191,645	191,645	1.64
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	-	170,557	170,557	1.45
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)	4,382,173	6,315,871	10,698,044	91.32
(一)店頭市場(OTC)	4,382,173	6,315,871	10,698,044	91.32
1.遠期契約(Outright Forwards) ²	375,737	684,033	1,059,770	9.05
2.換匯(Fx Swaps)	3,883,049	3,370,659	7,253,708	61.92
3.換匯換利(Currency Swaps)	64,979	3,576	68,555	0.58
4.買入選擇權(Bought Options)	29,507	1,114,205	1,143,712	9.76
5.賣出選擇權(Sold Options)	28,901	1,143,398	1,172,299	10.01
(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)	304,050	28,296	332,346	2.84
(一)店頭市場(OTC)	174	1,753	1,927	0.02
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	303,876	26,543	330,419	2.82
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	1,690	23,200	24,890	0.21
(一)店頭市場(OTC)	-	14,711	14,711	0.12
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	1,690	8,489	10,179	0.09
小 計(一至四)	4,915,675	6,789,164	11,704,839	99.91
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	10,694	10,694	0.09
1.信用違約交換(Credit Default Swap)	-	10,694	10,694	0.09
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	4,915,675	6,799,858	11,715,533	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6月		102年5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)	649,559	5.54	841,324	5.79	-191,765	-22.79
(一)店頭市場(OTC)	287,357	2.45	282,305	1.94	5,052	1.79
1. 遠期利率協議(FRA)	-	-	668	-	-668	-100.00
2. 換利(IRS)	272,064	2.32	256,260	1.76	15,804	6.17
3. 買入選擇權(Bought Options)	5,065	0.04	3,648	0.03	1,417	38.84
4. 賣出選擇權(Sold Options)	10,228	0.09	21,729	0.15	-11,501	-52.93
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	362,202	3.09	559,019	3.85	-196,817	-35.21
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	191,645	1.64	287,908	1.98	-96,263	-33.44
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	170,557	1.45	271,111	1.87	-100,554	-37.09
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)	10,698,044	91.32	13,192,471	90.85	-2,494,427	-18.91
(一)店頭市場(OTC)	10,698,044	91.32	13,192,471	90.85	-2,494,427	-18.91
1. 遠期契約(Outright Forwards) ²	1,059,770	9.05	1,261,744	8.69	-201,974	-16.01
2. 換匯(Fx Swaps)	7,253,708	61.92	8,257,676	56.87	-1,003,968	-12.16
3. 換匯換利(Currency Swaps)	68,555	0.58	52,473	0.36	16,082	30.65
4. 買入選擇權(Bought Options)	1,143,712	9.76	1,794,976	12.36	-651,264	-36.28
5. 賣出選擇權(Sold Options)	1,172,299	10.01	1,825,602	12.57	-653,303	-35.79
(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)	332,346	2.84	448,211	3.09	-115,865	-25.85
(一)店頭市場(OTC)	1,927	0.02	2,470	0.02	-543	-21.98
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	330,419	2.82	445,741	3.07	-115,322	-25.87
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	24,890	0.21	34,396	0.24	-9,506	-27.64
(一)店頭市場(OTC)	14,711	0.12	14,167	0.10	544	3.84
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	10,179	0.09	20,229	0.14	-10,050	-49.68
小 計(一至四)	11,704,839	99.91	14,516,402	99.97	-2,811,563	-19.37
五、信用有關契約(Credit Contracts)	10,694	0.09	4,515	0.03	6,179	136.85
1. 信用違約交換(Credit Default Swap)	10,694	0.09	4,515	0.03	6,179	136.85
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	11,715,533	100.00	14,520,917	100.00	-2,805,384	-19.32

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。

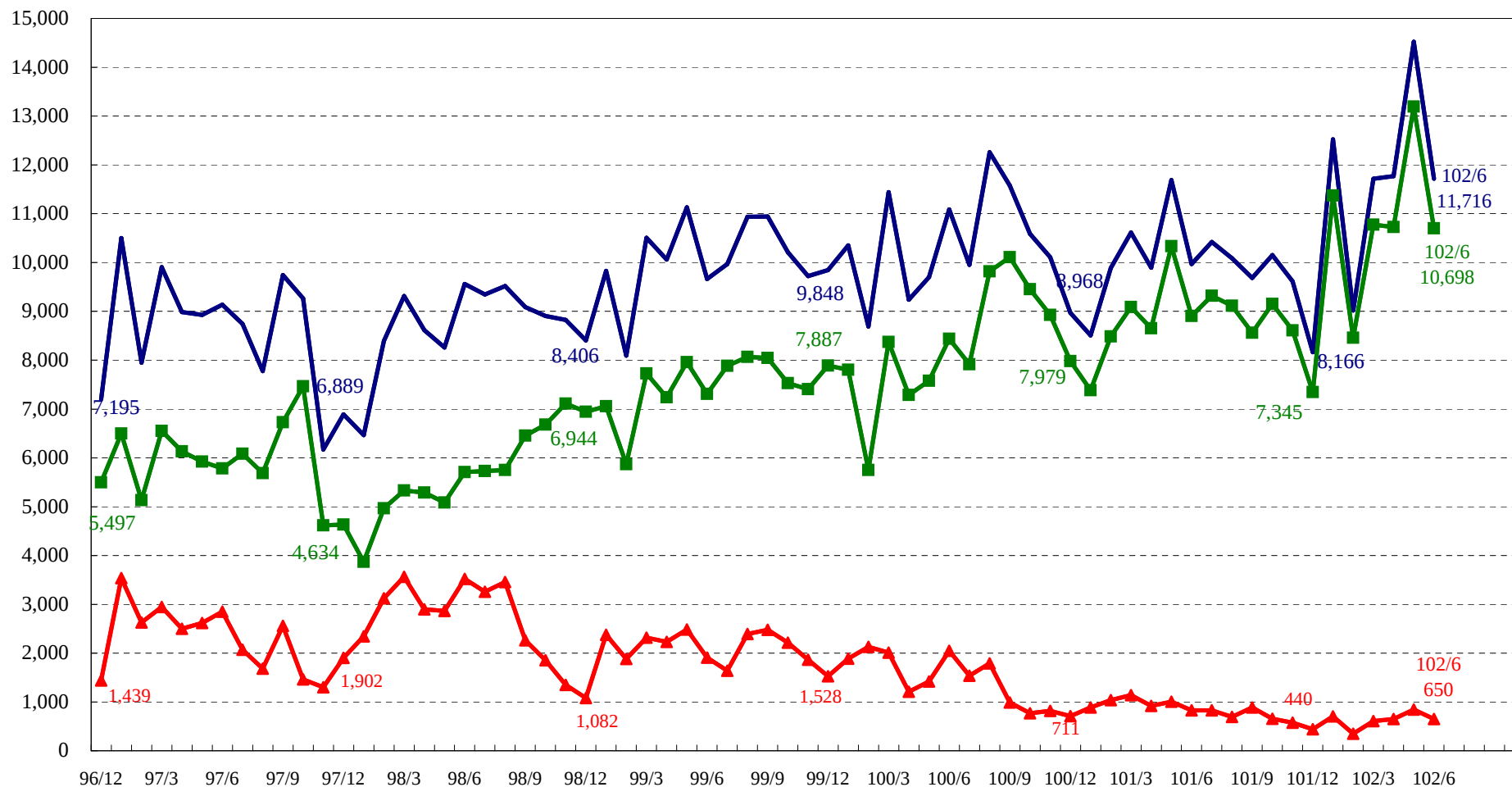
附圖1 102年6月銀行辦理衍生性金融商品交易量統計

新臺幣十億元

— 總交易量

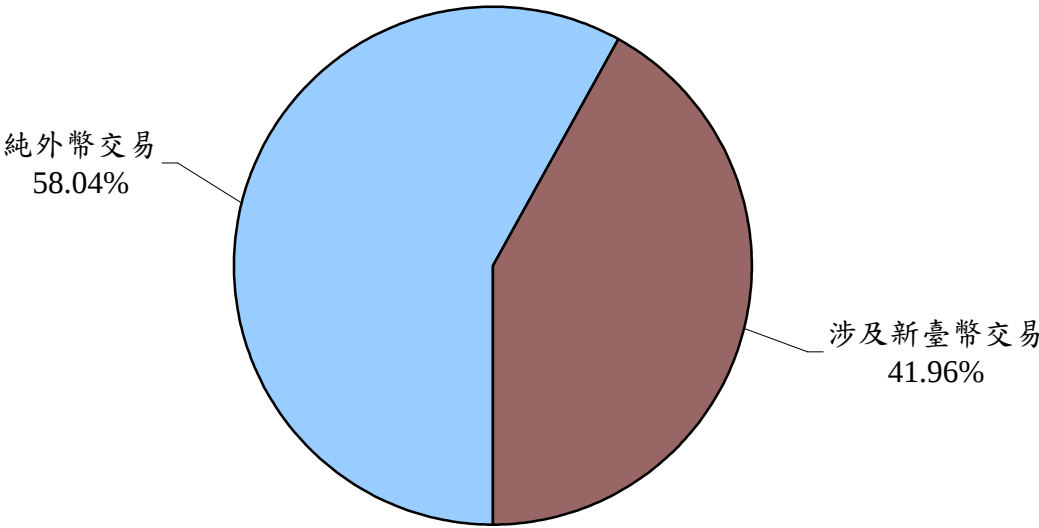
■ 匯率有關契約

▲ 利率有關契約



附圖2 102年6月銀行衍生性金融商品交易量內容分析

幣別



銀行類別

