

附表1 銀行衍生性金融商品交易量彙總表

104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 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)	59,949	388,818	448,767	3.26
(一)店頭市場(OTC)	59,949	39,657	99,606	0.72
1.遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-
2.換利(IRS)	57,305	35,196	92,501	0.67
3.買入選擇權(Bought Options)	581	-	581	-
4.賣出選擇權(Sold Options)	2,063	4,461	6,524	0.05
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	349,161	349,161	2.54
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	-	172,623	172,623	1.26
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	-	176,536	176,536	1.28
3.買入選擇權(Bought Options)	-	1	1	-
4.賣出選擇權(Sold Options)	-	1	1	-
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	4,749,866	8,123,940	12,873,806	93.71
(一)店頭市場(OTC)	4,749,866	8,123,940	12,873,806	93.71
1.遠期契約(Outright Forwards) ²	274,337	1,129,649	1,403,986	10.22
2.換匯(Fx Swaps)	4,331,536	4,068,576	8,400,112	61.15
3.換匯換利(Currency Swaps)	46,721	16,972	63,693	0.46
4.買入選擇權(Bought Options)	48,830	1,483,899	1,532,729	11.16
5.賣出選擇權(Sold Options)	48,442	1,424,844	1,473,286	10.72
(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)	358,648	8,975	367,623	2.68
(一)店頭市場(OTC)	135	431	566	0.01
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	358,513	8,544	367,057	2.67
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	689	43,992	44,681	0.33
(一)店頭市場(OTC)	8	8,669	8,677	0.07
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	681	35,323	36,004	0.26
小 計(一至四)	5,169,152	8,565,725	13,734,877	99.98
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	3,335	3,335	0.02
1.信用違約交換(Credit Default Swap)	-	3,335	3,335	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)	-	-	-	-
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	5,169,152	8,569,060	13,738,212	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	104年4月		104年3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)	448,767	3.26	475,403	3.31	-26,636	-5.60
(一)店頭市場(OTC)	99,606	0.72	177,873	1.24	-78,267	-44.00
1. 遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-	-	-
2. 換利(IRS)	92,501	0.67	153,998	1.08	-61,497	-39.93
3. 買入選擇權(Bought Options)	581	-	565	0.00	16	2.83
4. 賣出選擇權(Sold Options)	6,524	0.05	23,310	0.16	-16,786	-72.01
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	349,161	2.54	297,530	2.07	51,631	17.35
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	172,623	1.26	140,591	0.98	32,032	22.78
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	176,536	1.28	156,939	1.09	19,597	12.49
3. 買入選擇權(Bought Options)	1	-	-	-	1	-
4. 賣出選擇權(Sold Options)	1	-	-	-	1	-
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	12,873,806	93.71	13,514,628	94.24	-640,822	-4.74
(一)店頭市場(OTC)	12,873,806	93.71	13,514,628	94.24	-640,822	-4.74
1. 遠期契約(Outright Forwards) ²	1,403,986	10.22	1,519,602	10.60	-115,616	-7.61
2. 換匯(Fx Swaps)	8,400,112	61.15	8,910,362	62.13	-510,250	-5.73
3. 換匯換利(Currency Swaps)	63,693	0.46	166,088	1.16	-102,395	-61.65
4. 買入選擇權(Bought Options)	1,532,729	11.16	1,495,271	10.43	37,458	2.51
5. 賣出選擇權(Sold Options)	1,473,286	10.72	1,423,305	9.92	49,981	3.51
(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)	367,623	2.68	298,204	2.08	69,419	23.28
(一)店頭市場(OTC)	566	0.01	988	0.01	-422	-42.71
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	367,057	2.67	297,216	2.07	69,841	23.50
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	44,681	0.33	49,503	0.35	-4,822	-9.74
(一)店頭市場(OTC)	8,677	0.07	11,223	0.08	-2,546	-22.69
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	36,004	0.26	38,280	0.27	-2,276	-5.95
小 計(一至四)	13,734,877	99.98	14,337,738	99.98	-602,861	-4.20
五、信用有關契約(Credit Contracts)	3,335	0.02	2,740	0.02	595	21.72
1. 信用違約交換(Credit Default Swap)	3,335	0.02	2,740	0.02	595	21.72
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	13,738,212	100.00	14,340,478	100.00	-602,266	-4.20

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。

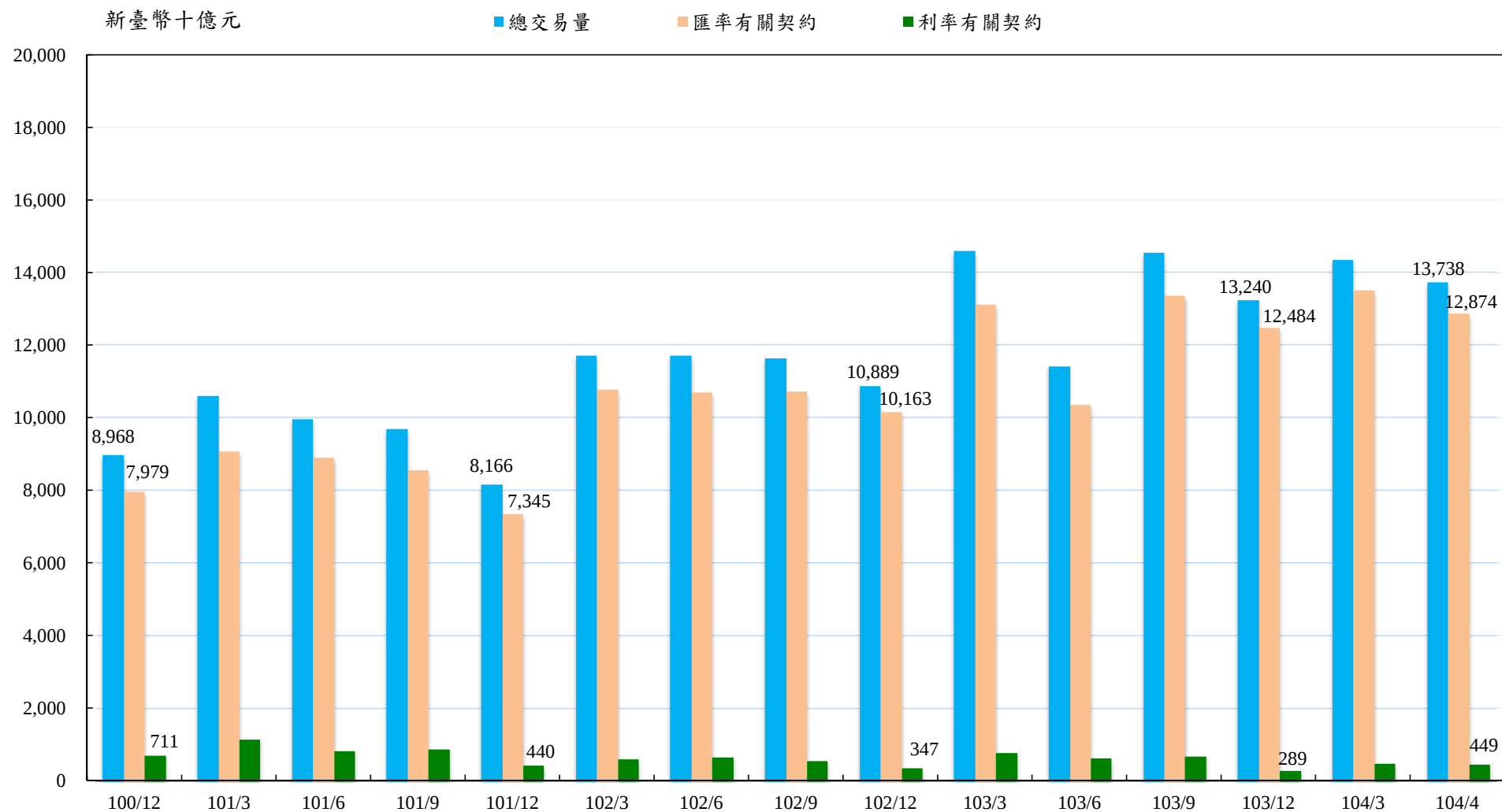
2. 「匯率有關—遠期契約」中「涉及新臺幣交易」金額包括新臺幣對外幣無本金交割遠期外匯交易；「純外幣交易」金額包括外幣保證金交易以遠期契約承作者。

附表3 銀行衍生性金融商品交易幣別比較表

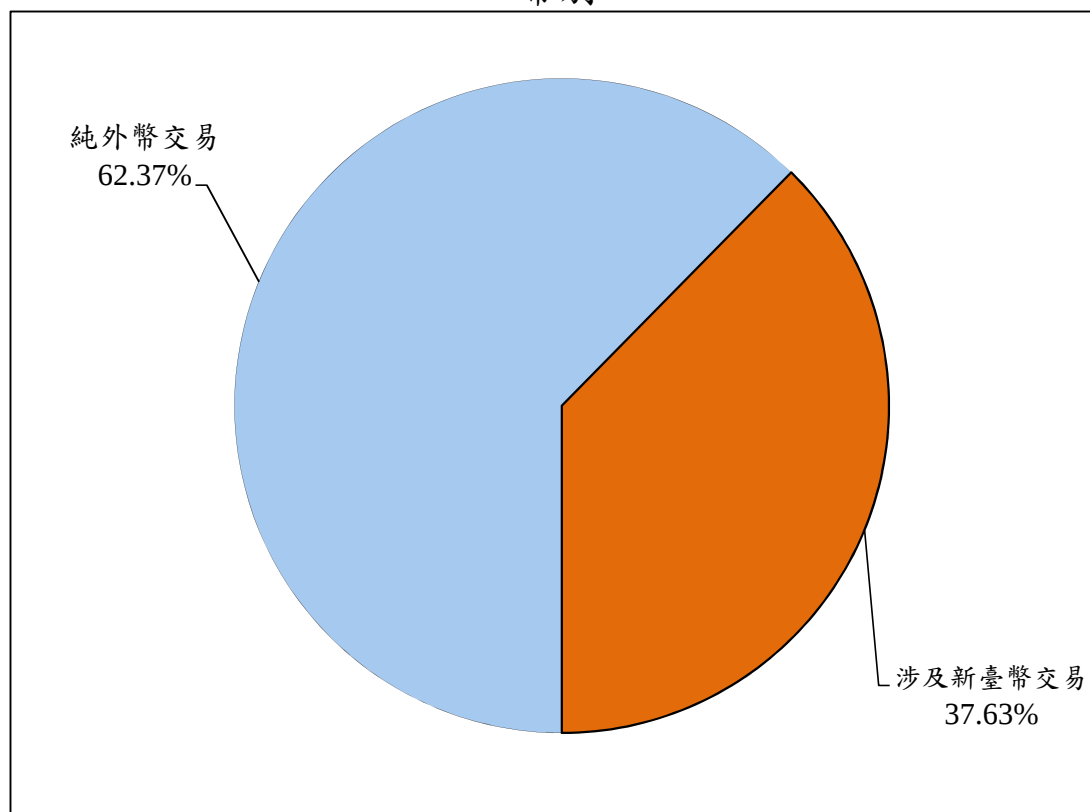
單位：新臺幣百萬元；%

商 品 種 類	104年4月		104年3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	5,169,152	37.63	5,293,970	36.92	-124,818	-2.36
一、利率有關契約(Interest Rate Contracts)	59,949	0.44	106,327	0.74	-46,378	-43.62
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	4,749,866	34.57	4,891,839	34.11	-141,973	-2.90
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	358,648	2.61	293,346	2.05	65,302	22.26
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	689	0.01	2,458	0.02	-1,769	-71.97
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	-	-	-	-	-
六、其他有關契約(Other Contracts)	-	-	-	-	-	-
純外幣交易量	8,569,060	62.37	9,046,508	63.08	-477,448	-5.28
一、利率有關契約(Interest Rate Contracts)	388,818	2.83	369,076	2.57	19,742	5.35
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	8,123,940	59.13	8,622,789	60.13	-498,849	-5.79
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	8,975	0.07	4,858	0.03	4,117	84.75
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	43,992	0.32	47,045	0.33	-3,053	-6.49
五、信用有關契約(Credit Contracts)	3,335	0.02	2,740	0.02	595	21.72
六、其他有關契約(Other Contracts)	-	-	-	-	-	-
總 計	13,738,212	100.00	14,340,478	100.00	-602,266	-4.20

附圖1 銀行辦理衍生性金融商品交易量統計



附圖2 104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

