

附表1 銀行衍生性金融商品交易量彙總表

商 品 種 類 別

105年3月

單位：新臺幣百萬元；％

商 品 種 類	本國銀行及外國與大陸地區銀行在台分行 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)	741,544	396,608	1,138,152	8.15
(一)店頭市場(OTC)	741,544	82,711	824,255	5.90
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	313,897	313,897	2.25
二、匯率有關契約²(Foreign Exchange Transactions)	6,169,027	6,239,230	12,408,257	88.93
(一)店頭市場(OTC)	6,169,027	6,175,110	12,344,137	88.47
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	64,120	64,120	0.46
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	377,126	7,746	384,872	2.76
(一)店頭市場(OTC)	78	243	321	-
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	377,048	7,503	384,551	2.76
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	787	15,591	16,378	0.12
(一)店頭市場(OTC)	-	8,582	8,582	0.06
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	787	7,009	7,796	0.06
小 計(一至四)	7,288,484	6,659,175	13,947,659	99.96
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	5,522	5,522	0.04
六、其他有關契約(Other Contracts)	-	-	-	-
總 計	7,288,484	6,664,697	13,953,181	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。

交 易 幣 別 比 較

單位：新臺幣百萬元；％

交 易 幣 別		涉及新臺幣交易	純外幣交易	合 計
105年3月	金 額	7,288,484	6,664,697	13,953,181
	比 重	52.24	47.76	100.00
105年2月	金 額	4,771,864	5,537,496	10,309,360
	比 重	46.29	53.71	100.00
比較增減	差 額	2,516,620	1,127,201	3,643,821
	變動率	52.74	20.36	35.34

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；%

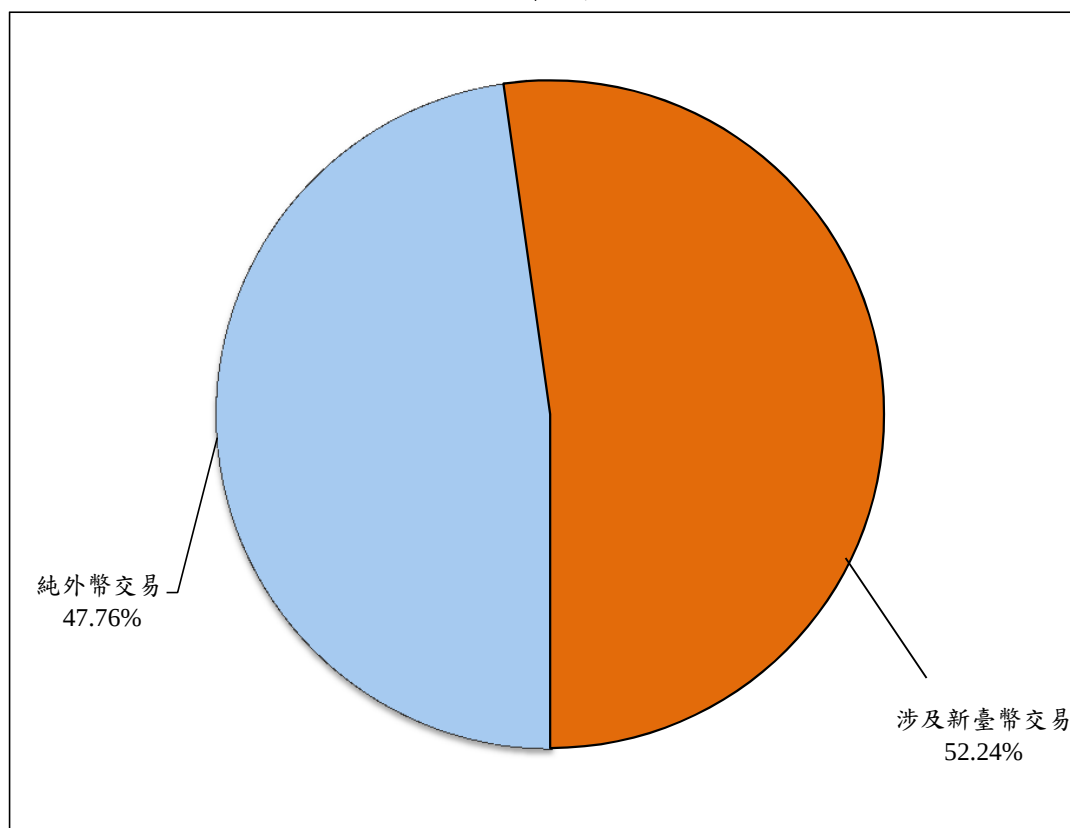
商 品 種 類	105年3月		105年2月		比較增減	
	合計	比重	合計	比重	差 額	變動率
一、利率有關契約(Interest Rate Contracts)	1,138,152	8.15	674,685	6.54	463,467	68.69
(一)店頭市場(OTC)	824,255	5.90	297,898	2.88	526,357	176.69
1. 遠期利率協議(FRA)	500	-	-	-	500	-
2. 換利(IRS)	782,053	5.60	290,176	2.81	491,877	169.51
3. 買入選擇權(Bought Options)	17,198	0.12	1,139	0.01	16,059	1,409.92
4. 賣出選擇權(Sold Options)	24,504	0.18	6,583	0.06	17,921	272.23
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	313,897	2.25	376,787	3.66	-62,890	-16.69
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	155,953	1.12	202,765	1.97	-46,812	-23.09
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	156,794	1.12	173,970	1.69	-17,176	-9.87
3. 買入選擇權(Bought Options)	1,150	0.01	52	-	1,098	2,111.54
4. 賣出選擇權(Sold Options)	-	-	-	-	-	-
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	12,408,257	88.93	9,413,587	91.31	2,994,670	31.81
(一)店頭市場(OTC)	12,344,137	88.47	9,369,674	90.88	2,974,463	31.75
1. 遠期契約(Outright Forwards)	1,437,281	10.30	1,256,001	12.18	181,280	14.43
2. 換匯(Fx Swaps)	9,607,967	68.86	6,929,494	67.22	2,678,473	38.65
3. 換匯換利(Currency Swaps)	143,027	1.02	70,144	0.68	72,883	103.90
4. 買入選擇權(Bought Options)	587,098	4.21	562,215	5.45	24,883	4.43
5. 賣出選擇權(Sold Options)	568,764	4.08	551,820	5.35	16,944	3.07
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	64,120	0.46	43,913	0.43	20,207	46.02
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	32,081	0.23	22,404	0.22	9,677	43.19
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	32,039	0.23	21,509	0.21	10,530	48.96
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)	384,872	2.76	205,208	1.99	179,664	87.55
(一)店頭市場(OTC)	321	-	126	-	195	154.76
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	384,551	2.76	205,082	1.99	179,469	87.51
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	16,378	0.12	10,205	0.10	6,173	60.49
(一)店頭市場(OTC)	8,582	0.06	4,305	0.04	4,277	99.35
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	7,796	0.06	5,900	0.06	1,896	32.14
小 計(一至四)	13,947,659	99.96	10,303,685	99.94	3,643,974	35.37
五、信用有關契約(Credit Contracts)	5,522	0.04	5,675	0.06	-153	-2.70
1. 信用違約交換(Credit Default Swap)	5,522	0.04	5,675	0.06	-153	-2.70
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^註	13,953,181	100.00	10,309,360	100.00	3,643,821	35.34

註：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。

附圖1 銀行辦理衍生性金融商品交易量趨勢統計



附圖2 105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

