

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12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)	148,863	305,707	454,570	3.82
（一）店頭市場(OTC)	148,863	142,721	291,584	2.45
（二）交易所(Exchange-traded Contracts)	-	162,986	162,986	1.37
二、匯率有關契約²(Foreign Exchange Transactions)	6,225,350	5,072,139	11,297,489	94.91
（一）店頭市場(OTC)	6,225,350	4,980,902	11,206,252	94.14
（二）交易所(Exchange-traded Contracts)	-	91,237	91,237	0.77
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	138,024	2,412	140,436	1.18
（一）店頭市場(OTC)	123	417	540	-
（二）交易所(Exchange-traded Contracts)	137,901	1,995	139,896	1.18
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	696	9,216	9,912	0.08
（一）店頭市場(OTC)	-	6,057	6,057	0.05
（二）交易所(Exchange-traded Contracts)	696	3,159	3,855	0.03
小 計(一至四)	6,512,933	5,389,474	11,902,407	99.99
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	969	969	0.01
六、其他有關契約(Other Contracts)	-	-	-	-
總 計	6,512,933	5,390,443	11,903,376	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12月	金 額	6,512,933	5,390,443	11,903,376
	比 重	54.72	45.28	100.00
105年11月	金 額	7,096,346	6,708,334	13,804,680
	比 重	51.41	48.59	100.00
比較增減	差 額	-583,413	-1,317,891	-1,901,304
	變動率	-8.22	-19.65	-13.77

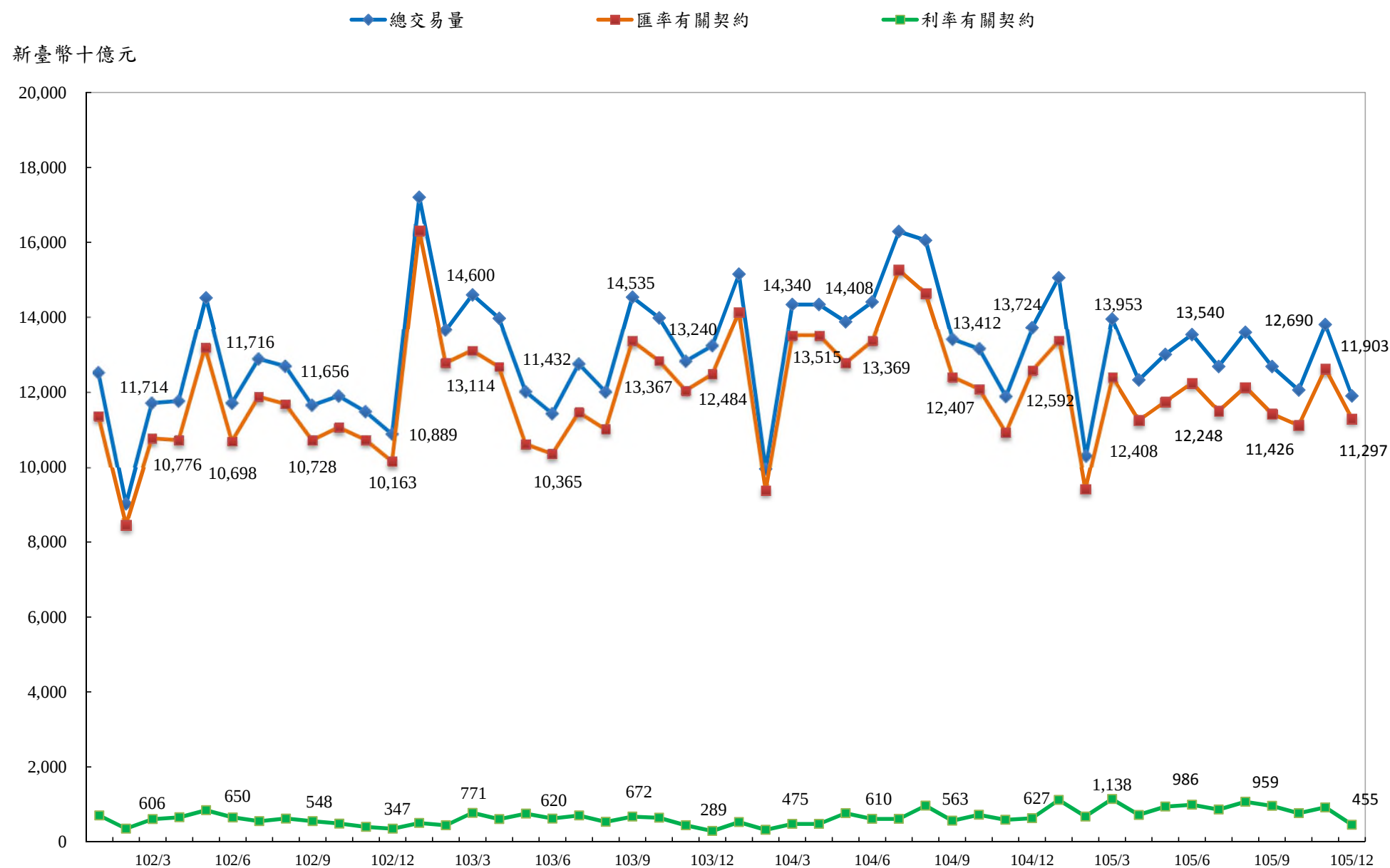
附表2 銀行衍生性金融商品交易量比較表

單位：新臺幣百萬元；%

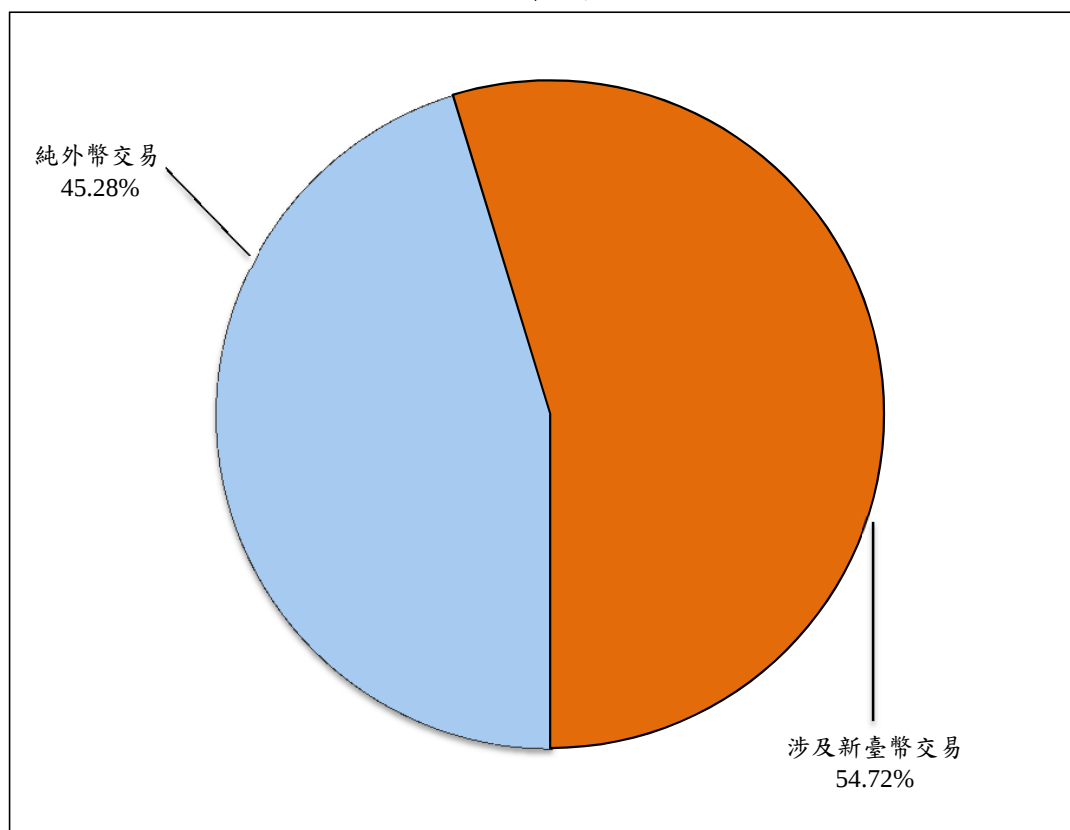
商 品 種 類	105年12月		105年11月		比較增減	
	合計	比重	合計	比重	差 額	變動率
一、利率有關契約(Interest Rate Contracts)	454,570	3.82	917,910	6.65	-463,340	-50.48
(一)店頭市場(OTC)	291,584	2.45	483,800	3.50	-192,216	-39.73
1. 遠期利率協議(FRA)	3,868	0.03	-	-	3,868	-
2. 換利(IRS)	275,417	2.31	430,141	3.11	-154,724	-35.97
3. 買入選擇權(Bought Options)	8,163	0.07	24,935	0.18	-16,772	-67.26
4. 賣出選擇權(Sold Options)	4,136	0.04	28,724	0.21	-24,588	-85.60
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	162,986	1.37	434,110	3.15	-271,124	-62.46
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	92,246	0.78	216,772	1.57	-124,526	-57.45
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	69,904	0.59	210,051	1.52	-140,147	-66.72
3. 買入選擇權(Bought Options)	329	-	5,055	0.04	-4,726	-93.49
4. 賣出選擇權(Sold Options)	507	-	2,232	0.02	-1,725	-77.28
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	11,297,489	94.91	12,627,020	91.47	-1,329,531	-10.53
(一)店頭市場(OTC)	11,206,252	94.14	12,557,132	90.96	-1,350,880	-10.76
1. 遠期契約(Outright Forwards)	1,222,768	10.27	1,573,591	11.40	-350,823	-22.29
2. 換匯(Fx Swaps)	9,303,849	78.16	9,926,747	71.91	-622,898	-6.27
3. 換匯換利(Currency Swaps)	132,099	1.11	150,043	1.08	-17,944	-11.96
4. 買入選擇權(Bought Options)	281,776	2.37	460,687	3.34	-178,911	-38.84
5. 賣出選擇權(Sold Options)	265,760	2.23	446,064	3.23	-180,304	-40.42
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	91,237	0.77	69,888	0.51	21,349	30.55
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	42,048	0.35	31,470	0.23	10,578	33.61
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	41,783	0.35	31,315	0.23	10,468	33.43
3. 買入選擇權(Bought Options)	4,452	0.04	3,600	0.03	852	23.67
4. 賣出選擇權(Sold Options)	2,954	0.03	3,503	0.02	-549	-15.67
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	140,436	1.18	248,455	1.80	-108,019	-43.48
(一)店頭市場(OTC)	540	-	195	-	345	176.92
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	139,896	1.18	248,260	1.80	-108,364	-43.65
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	9,912	0.08	10,179	0.07	-267	-2.62
(一)店頭市場(OTC)	6,057	0.05	7,970	0.06	-1,913	-24.00
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	3,855	0.03	2,209	0.01	1,646	74.51
小 計(一至四)	11,902,407	99.99	13,803,564	99.99	-1,901,157	-13.77
五、信用有關契約(Credit Contracts)	969	0.01	1,116	0.01	-147	-13.17
1. 信用違約交換(Credit Default Swap)	969	0.01	1,116	0.01	-147	-13.17
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	11,903,376	100.00	13,804,680	100.00	-1,901,304	-13.77

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12月銀行衍生性金融商品交易量內容分析
幣別



銀行類別

