

附表1 銀行衍生性金融商品交易量彙總表
商 品 種 類 別

106年2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)	188,396	489,103	677,499	6.12
（一）店頭市場(OTC)	188,356	162,772	351,128	3.17
（二）交易所(Exchange-traded Contracts)	40	326,331	326,371	2.95
二、匯率有關契約 ² (Foreign Exchange Transactions)	5,702,206	4,504,014	10,206,220	92.21
（一）店頭市場(OTC)	5,702,206	4,411,661	10,113,867	91.38
（二）交易所(Exchange-traded Contracts)	-	92,353	92,353	0.83
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	163,851	4,727	168,578	1.52
（一）店頭市場(OTC)	-	361	361	0.00
（二）交易所(Exchange-traded Contracts)	163,851	4,366	168,217	1.52
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	702	12,830	13,532	0.12
（一）店頭市場(OTC)	-	8,285	8,285	0.07
（二）交易所(Exchange-traded Contracts)	702	4,545	5,247	0.05
小 計(一至四)	6,055,155	5,010,674	11,065,829	99.97
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	2,764	2,764	0.03
六、其他有關契約(Other Contracts)	-	-	-	-
總 計	6,055,155	5,013,438	11,068,593	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
106年2月	金 額	6,055,155	5,013,438	11,068,593
	比 重	54.71	45.29	100.00
106年1月	金 額	6,366,877	5,112,635	11,479,512
	比 重	55.46	44.54	100.00
比較增減	差 額	-311,722	-99,197	-410,919
	變動率	-4.90	-1.94	-3.58

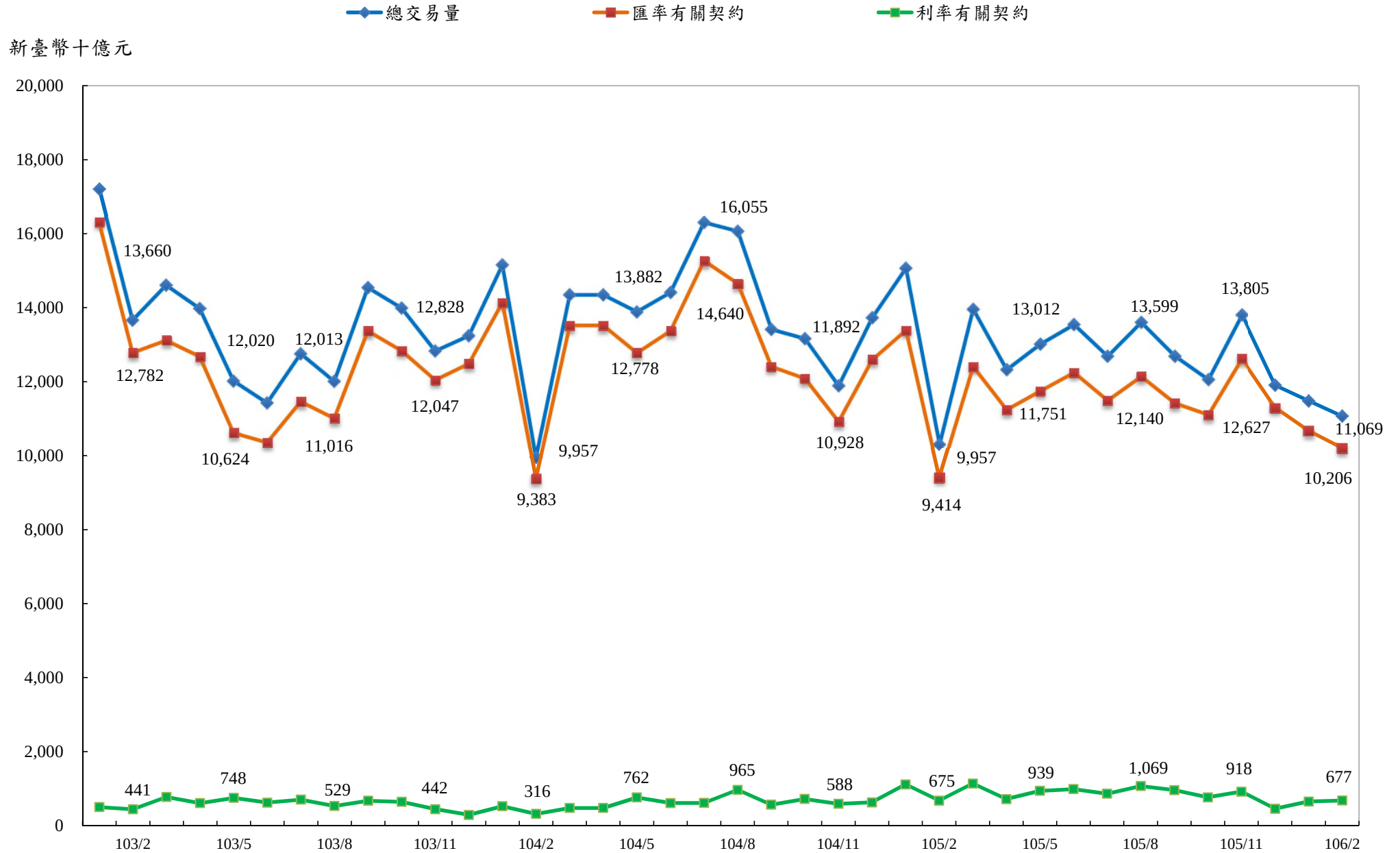
附表2 銀行衍生性金融商品交易量比較表

單位：新臺幣百萬元；%

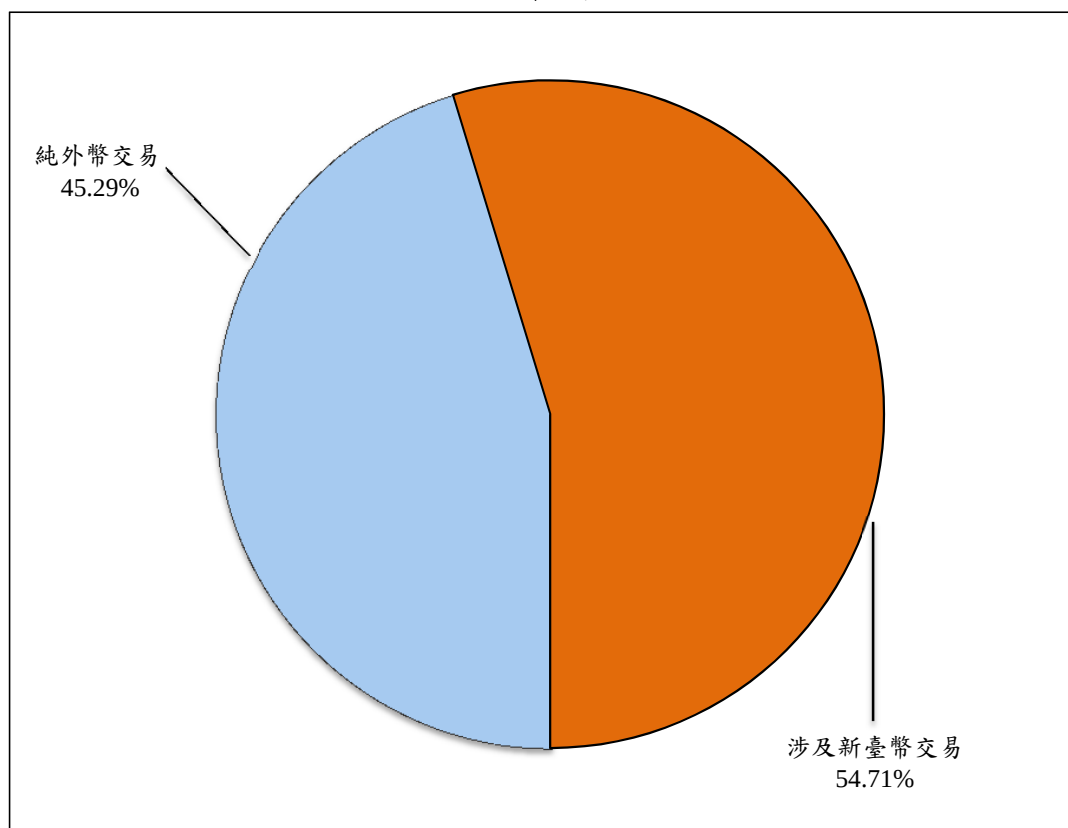
商 品 種 類	106年2月		106年1月		比較增減	
	合計	比重	合計	比重	差 額	變動率
一、利率有關契約(Interest Rate Contracts)	677,499	6.12	651,143	5.67	26,356	4.05
(一)店頭市場(OTC)	351,128	3.17	335,537	2.92	15,591	4.65
1. 遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-	-	-
2. 換利(IRS)	320,408	2.89	298,364	2.60	22,044	7.39
3. 買入選擇權(Bought Options)	1,750	0.02	94	-	1,656	1,761.70
4. 賣出選擇權(Sold Options)	28,970	0.26	37,079	0.32	-8,109	-21.87
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	326,371	2.95	315,606	2.75	10,765	3.41
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	162,260	1.47	158,907	1.39	3,353	2.11
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	164,071	1.48	156,073	1.36	7,998	5.12
3. 買入選擇權(Bought Options)	-	-	220	-	-220	-100.00
4. 賣出選擇權(Sold Options)	40	-	406	-	-366	-90.15
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	10,206,220	92.21	10,671,207	92.96	-464,987	-4.36
(一)店頭市場(OTC)	10,113,867	91.38	10,641,041	92.70	-527,174	-4.95
1. 遠期契約(Outright Forwards)	1,034,338	9.35	1,117,798	9.74	-83,460	-7.47
2. 換匯(Fx Swaps)	8,346,797	75.41	8,789,875	76.57	-443,078	-5.04
3. 換匯換利(Currency Swaps)	99,663	0.90	60,999	0.53	38,664	63.38
4. 買入選擇權(Bought Options)	325,140	2.94	340,664	2.97	-15,524	-4.56
5. 賣出選擇權(Sold Options)	307,929	2.78	331,705	2.89	-23,776	-7.17
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	92,353	0.83	30,166	0.26	62,187	206.15
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	39,252	0.36	12,502	0.11	26,750	213.97
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	38,910	0.35	12,375	0.11	26,535	214.42
3. 買入選擇權(Bought Options)	7,078	0.06	2,871	0.02	4,207	146.53
4. 賣出選擇權(Sold Options)	7,113	0.06	2,418	0.02	4,695	194.17
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	168,578	1.52	136,549	1.19	32,029	23.46
(一)店頭市場(OTC)	361	-	956	0.01	-595	-62.24
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	168,217	1.52	135,593	1.18	32,624	24.06
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	13,532	0.12	19,056	0.17	-5,524	-28.99
(一)店頭市場(OTC)	8,285	0.07	9,363	0.08	-1,078	-11.51
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	5,247	0.05	9,693	0.09	-4,446	-45.87
小 計(一至四)	11,065,829	99.97	11,477,955	99.99	-412,126	-3.59
五、信用有關契約(Credit Contracts)	2,764	0.03	1,557	0.01	1,207	77.52
1. 信用違約交換(Credit Default Swap)	2,764	0.03	1,557	0.01	1,207	77.52
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	11,068,593	100.00	11,479,512	100.00	-410,919	-3.58

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2 106年2月銀行衍生性金融商品交易量內容分析
幣別



銀行類別

