

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1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)	263, 543	850, 072	1, 113, 615	7. 40
(一)店頭市場(OTC)	263, 543	158, 616	422, 159	2. 81
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	691, 456	691, 456	4. 59
二、匯率有關契約²(Foreign Exchange Transactions)	6, 178, 379	7, 204, 960	13, 383, 339	88. 88
(一)店頭市場(OTC)	6, 178, 379	7, 070, 284	13, 248, 663	87. 99
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	134, 676	134, 676	0. 89
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	516, 289	18, 307	534, 596	3. 55
(一)店頭市場(OTC)	-	300	300	-
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	516, 289	18, 007	534, 296	3. 55
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	905	18, 139	19, 044	0. 13
(一)店頭市場(OTC)	-	7, 666	7, 666	0. 05
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	905	10, 473	11, 378	0. 08
小 計(一至四)	6, 959, 116	8, 091, 478	15, 050, 594	99. 96
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	6, 665	6, 665	0. 04
六、其他有關契約(Other Contracts)	-	-	-	-
總 計	6, 959, 116	8, 098, 143	15, 057, 259	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1月	金 額	6, 959, 116	8, 098, 143	15, 057, 259
	比 重	46. 22	53. 78	100. 00
104年12月	金 額	6, 285, 355	7, 438, 565	13, 723, 920
	比 重	45. 80	54. 20	100. 00
比較增減	差 額	673, 761	659, 578	1, 333, 339
	變動率	10. 72	8. 87	9. 72

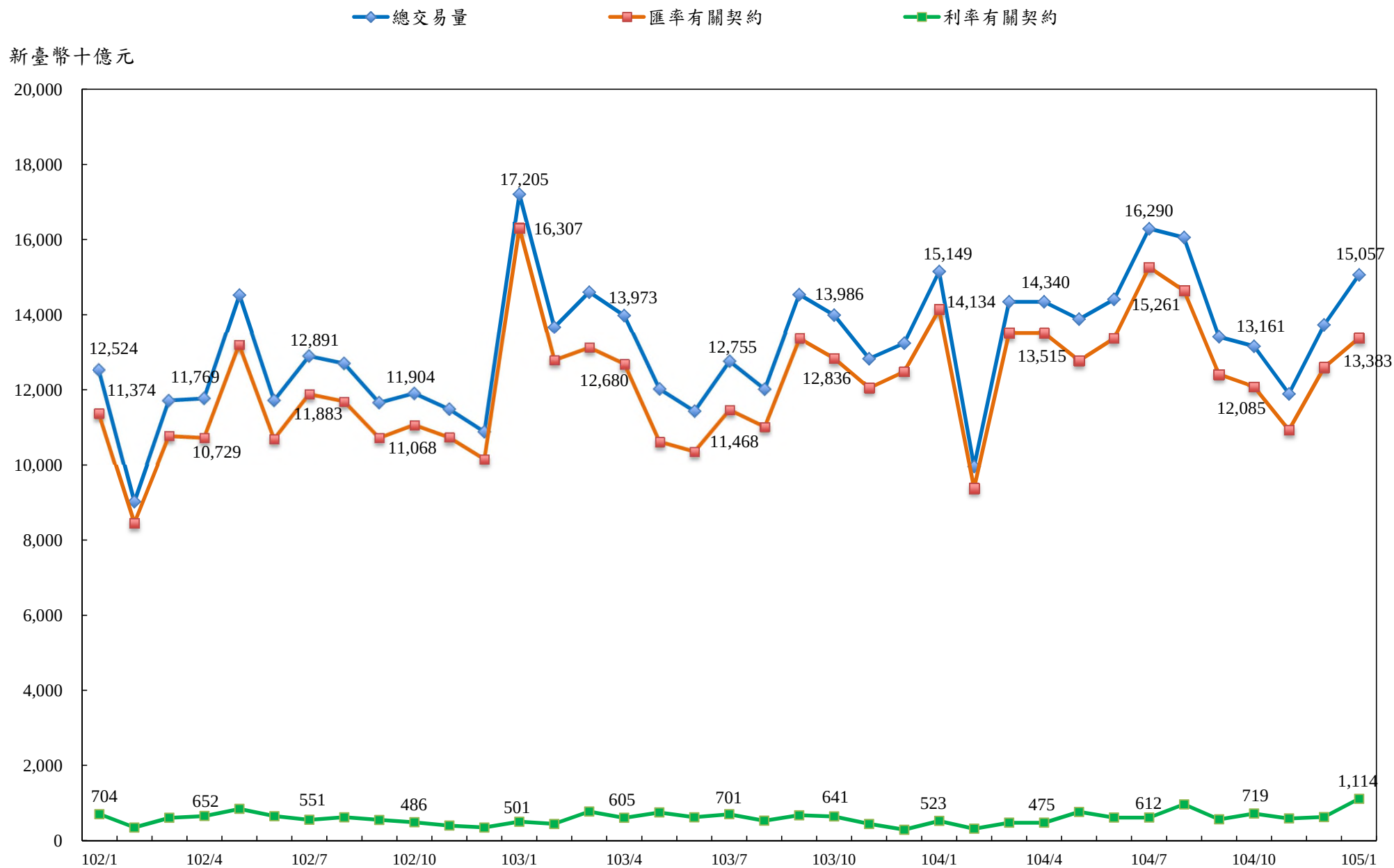
附表2 銀行衍生性金融商品交易量比較表

單位：新臺幣百萬元；%

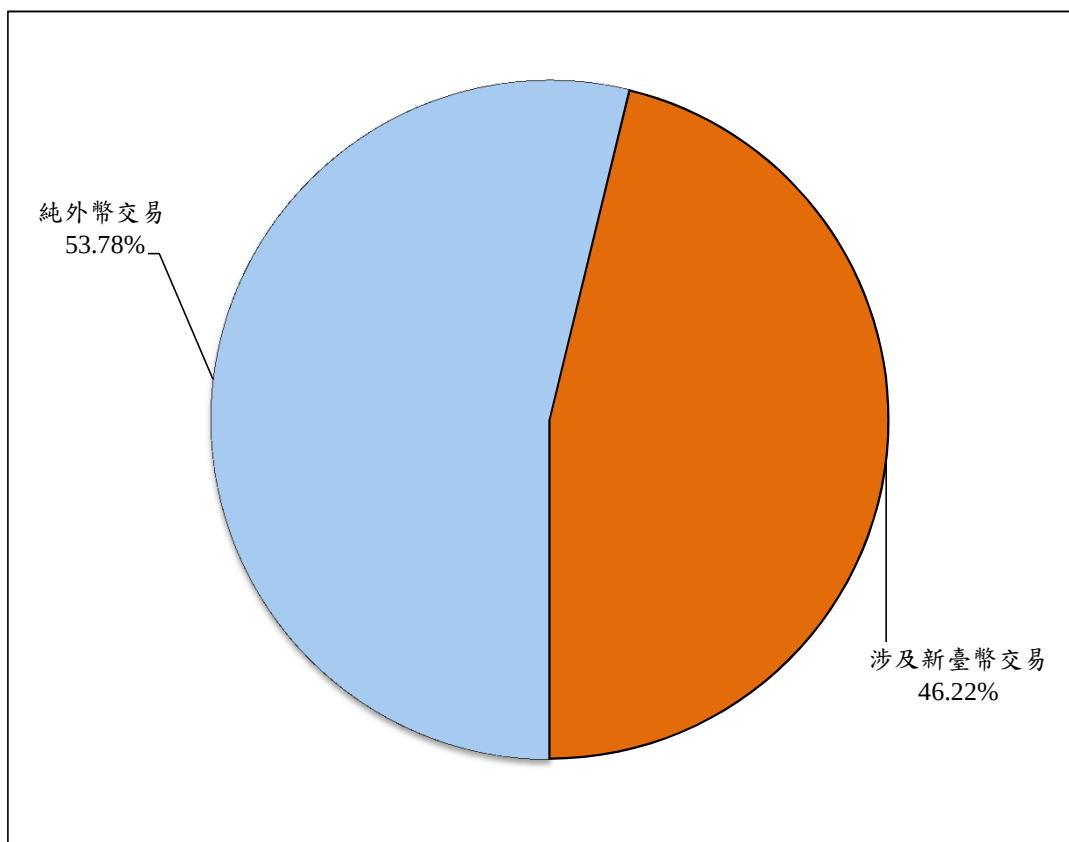
商 品 種 類	105年1月		104年12月		比較增減	
	合計	比重	合計	比重	差 額	變動率
一、利率有關契約(Interest Rate Contracts)	1,113,615	7.40	626,752	4.57	486,863	77.68
(一)店頭市場(OTC)	422,159	2.81	339,270	2.47	82,889	24.43
1. 遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-	-	-
2. 換利(IRS)	412,154	2.74	334,872	2.44	77,282	23.08
3. 買入選擇權(Bought Options)	1,351	0.01	437	-	914	209.15
4. 賣出選擇權(Sold Options)	8,654	0.06	3,961	0.03	4,693	118.48
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	691,456	4.59	287,482	2.10	403,974	140.52
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	322,271	2.14	149,792	1.09	172,479	115.15
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	367,974	2.44	133,874	0.98	234,100	174.87
3. 買入選擇權(Bought Options)	1,194	0.01	1,661	0.01	-467	-28.12
4. 賣出選擇權(Sold Options)	17	-	2,155	0.02	-2,138	-99.21
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	13,383,339	88.88	12,592,201	91.75	791,138	6.28
(一)店頭市場(OTC)	13,248,663	87.99	12,110,232	88.24	1,138,431	9.40
1. 遠期契約(Outright Forwards)	1,418,336	9.42	1,182,528	8.62	235,808	19.94
2. 換匯(Fx Swaps)	9,887,040	65.66	9,656,575	70.36	230,465	2.39
3. 換匯換利(Currency Swaps)	88,289	0.59	70,143	0.51	18,146	25.87
4. 買入選擇權(Bought Options)	931,480	6.19	614,873	4.48	316,607	51.49
5. 賣出選擇權(Sold Options)	923,518	6.13	586,113	4.27	337,405	57.57
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	134,676	0.89	481,969	3.51	-347,293	-72.06
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	67,154	0.44	240,322	1.75	-173,168	-72.06
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	67,522	0.45	241,647	1.76	-174,125	-72.06
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)	534,596	3.55	491,128	3.58	43,468	8.85
(一)店頭市場(OTC)	300	-	593	0.01	-293	-49.41
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	534,296	3.55	490,535	3.57	43,761	8.92
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	19,044	0.13	12,666	0.09	6,378	50.36
(一)店頭市場(OTC)	7,666	0.05	8,618	0.06	-952	-11.05
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	11,378	0.08	4,048	0.03	7,330	181.08
小 計(一至四)	15,050,594	99.96	13,722,747	99.99	1,327,847	9.68
五、信用有關契約(Credit Contracts)	6,665	0.04	1,173	0.01	5,492	468.20
1. 信用違約交換(Credit Default Swap)	6,665	0.04	1,173	0.01	5,492	468.20
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	15,057,259	100.00	13,723,920	100.00	1,333,339	9.72

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1月銀行衍生性金融商品交易量內容分析
幣別



銀行類別

