

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10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, 229	946, 670	1, 134, 899	9. 62
（一）店頭市場(OTC)	187, 505	231, 773	419, 278	3. 55
（二）交易所(Exchange-traded Contracts)	724	714, 897	715, 621	6. 07
二、匯率有關契約²(Foreign Exchange Transactions)	5, 669, 873	4, 724, 129	10, 394, 002	88. 13
（一）店頭市場(OTC)	5, 669, 873	4, 676, 736	10, 346, 609	87. 73
（二）交易所(Exchange-traded Contracts)	-	47, 393	47, 393	0. 40
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	247, 109	3, 156	250, 265	2. 12
（一）店頭市場(OTC)	-	219	219	-
（二）交易所(Exchange-traded Contracts)	247, 109	2, 937	250, 046	2. 12
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	708	14, 417	15, 125	0. 13
（一）店頭市場(OTC)	-	6, 663	6, 663	0. 06
（二）交易所(Exchange-traded Contracts)	708	7, 754	8, 462	0. 07
小 計(一至四)	6, 105, 919	5, 688, 372	11, 794, 291	100. 00
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	302	302	-
六、其他有關契約(Other Contracts)	-	-	-	-
總 計	6, 105, 919	5, 688, 674	11, 794, 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10月	金 額	6, 105, 919	5, 688, 674	11, 794, 593
	比 重	51. 77	48. 23	100. 00
106年9月	金 額	6, 435, 515	6, 424, 581	12, 860, 096
	比 重	50. 04	49. 96	100. 00
比較增減	差 額	-329, 596	-735, 907	-1, 065, 503
	變動率	-5. 12	-11. 45	-8. 29

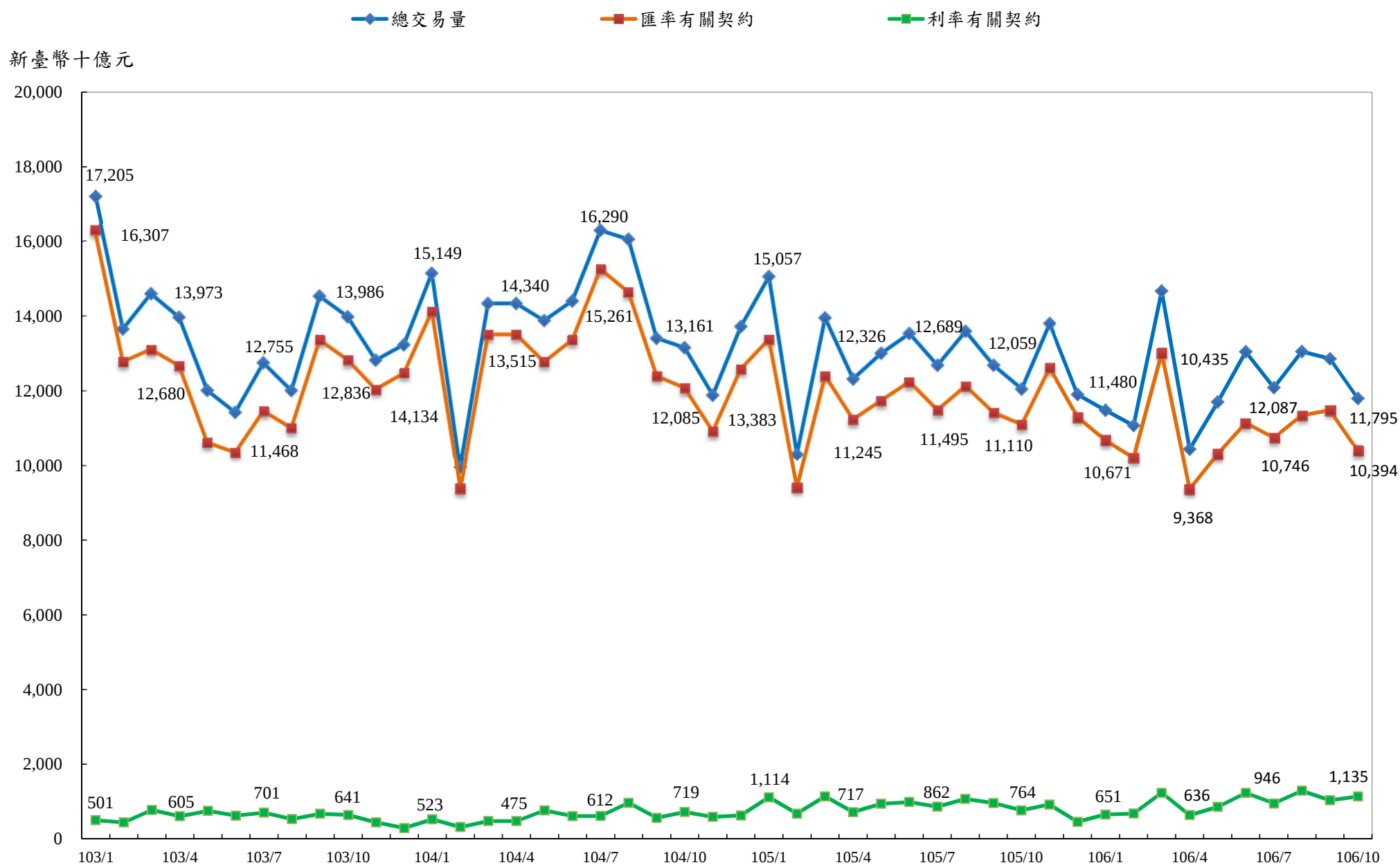
附表2 銀行衍生性金融商品交易量比較表

單位：新臺幣百萬元；%

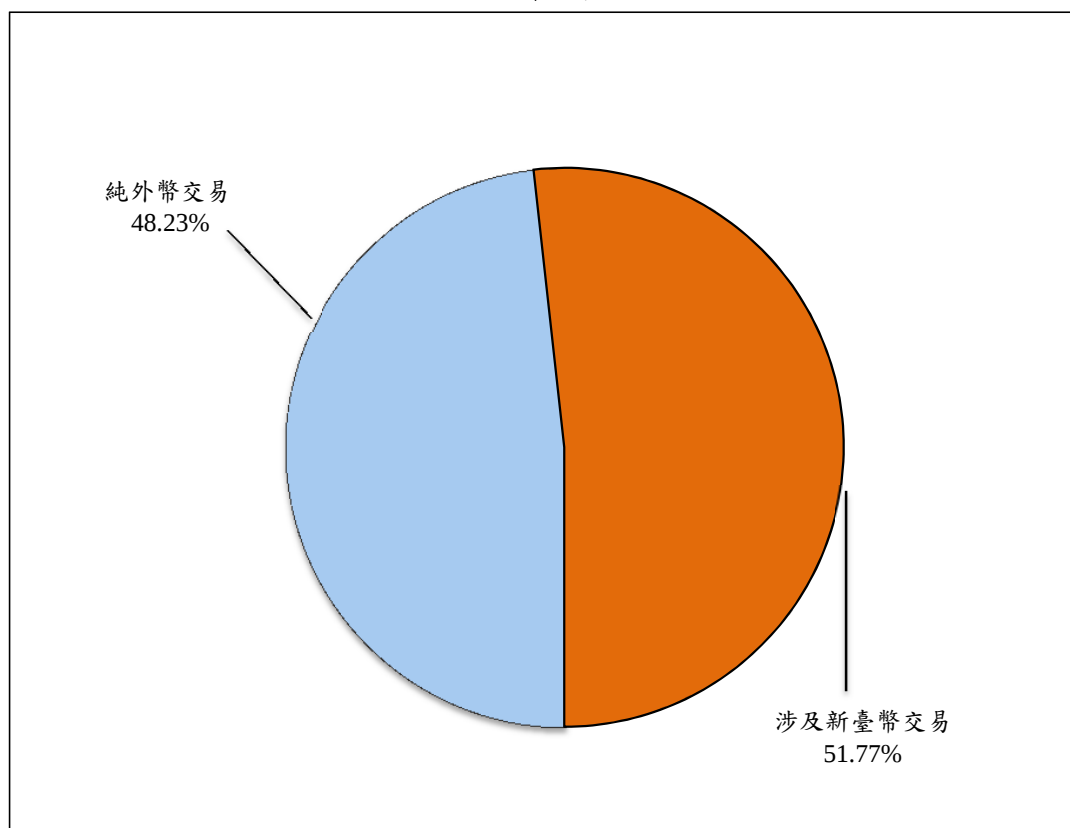
商 品 種 類	106年10月		106年9月		比較增減	
	合計	比重	合計	比重	差 額	變動率
一、利率有關契約(Interest Rate Contracts)	1,134,899	9.62	1,034,277	8.05	100,622	9.73
(一)店頭市場(OTC)	419,278	3.55	324,441	2.53	94,837	29.23
1. 遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-	-	-
2. 換利(IRS)	338,030	2.86	287,687	2.24	50,343	17.50
3. 買入選擇權(Bought Options)	1,000	0.01	3,636	0.03	-2,636	-72.50
4. 賣出選擇權(Sold Options)	80,248	0.68	33,118	0.26	47,130	142.31
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	715,621	6.07	709,836	5.52	5,785	0.81
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	372,982	3.16	377,115	2.93	-4,133	-1.10
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	341,915	2.90	329,984	2.57	11,931	3.62
3. 買入選擇權(Bought Options)	-	-	1,212	0.01	-1,212	-100.00
4. 賣出選擇權(Sold Options)	724	0.01	1,525	0.01	-801	-52.52
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	10,394,002	88.13	11,480,239	89.27	-1,086,237	-9.46
(一)店頭市場(OTC)	10,346,609	87.73	11,418,048	88.79	-1,071,439	-9.38
1. 遠期契約(Outright Forwards)	1,004,810	8.52	1,124,966	8.75	-120,156	-10.68
2. 換匯(Fx Swaps)	8,753,415	74.22	9,504,526	73.91	-751,111	-7.90
3. 換匯換利(Currency Swaps)	80,074	0.68	94,302	0.73	-14,228	-15.09
4. 買入選擇權(Bought Options)	262,620	2.23	358,856	2.79	-96,236	-26.82
5. 賣出選擇權(Sold Options)	245,690	2.08	335,398	2.61	-89,708	-26.75
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	47,393	0.40	62,191	0.48	-14,798	-23.79
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	18,854	0.16	21,927	0.17	-3,073	-14.01
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	18,210	0.15	22,124	0.17	-3,914	-17.69
3. 買入選擇權(Bought Options)	5,673	0.05	8,627	0.07	-2,954	-34.24
4. 賣出選擇權(Sold Options)	4,656	0.04	9,513	0.07	-4,857	-51.06
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	250,265	2.12	330,823	2.57	-80,558	-24.35
(一)店頭市場(OTC)	219	-	137	-	82	59.85
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	250,046	2.12	330,686	2.57	-80,640	-24.39
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	15,125	0.13	11,576	0.09	3,549	30.66
(一)店頭市場(OTC)	6,663	0.06	6,604	0.05	59	0.89
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	8,462	0.07	4,972	0.04	3,490	70.19
小 計(一至四)	11,794,291	100.00	12,856,915	99.98	-1,062,624	-8.26
五、信用有關契約(Credit Contracts)	302	-	3,181	0.02	-2,879	-90.51
1. 信用違約交換(Credit Default Swap)	302	-	3,181	0.02	-2,879	-90.51
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	11,794,593	100.00	12,860,096	100.00	-1,065,503	-8.29

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10月銀行衍生性金融商品交易量內容分析
幣別



銀行類別

