

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1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)	144,340	506,803	651,143	5.67
(一)店頭市場(OTC)	144,279	191,258	335,537	2.92
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	61	315,545	315,606	2.75
二、匯率有關契約²(Foreign Exchange Transactions)	6,089,719	4,581,488	10,671,207	92.96
(一)店頭市場(OTC)	6,089,719	4,551,322	10,641,041	92.70
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	30,166	30,166	0.26
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	132,154	4,395	136,549	1.19
(一)店頭市場(OTC)	50	906	956	0.01
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	132,104	3,489	135,593	1.18
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	664	18,392	19,056	0.17
(一)店頭市場(OTC)	-	9,363	9,363	0.08
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	664	9,029	9,693	0.09
小 計(一至四)	6,366,877	5,111,078	11,477,955	99.99
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	1,557	1,557	0.01
六、其他有關契約(Other Contracts)	-	-	-	-
總 計	6,366,877	5,112,635	11,479,512	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1月	金 額	6,366,877	5,112,635	11,479,512
	比 重	55.46	44.54	100.00
105年12月	金 額	6,512,933	5,390,443	11,903,376
	比 重	54.72	45.28	100.00
比較增減	差 額	-146,056	-277,808	-423,864
	變動率	-2.24	-5.15	-3.56

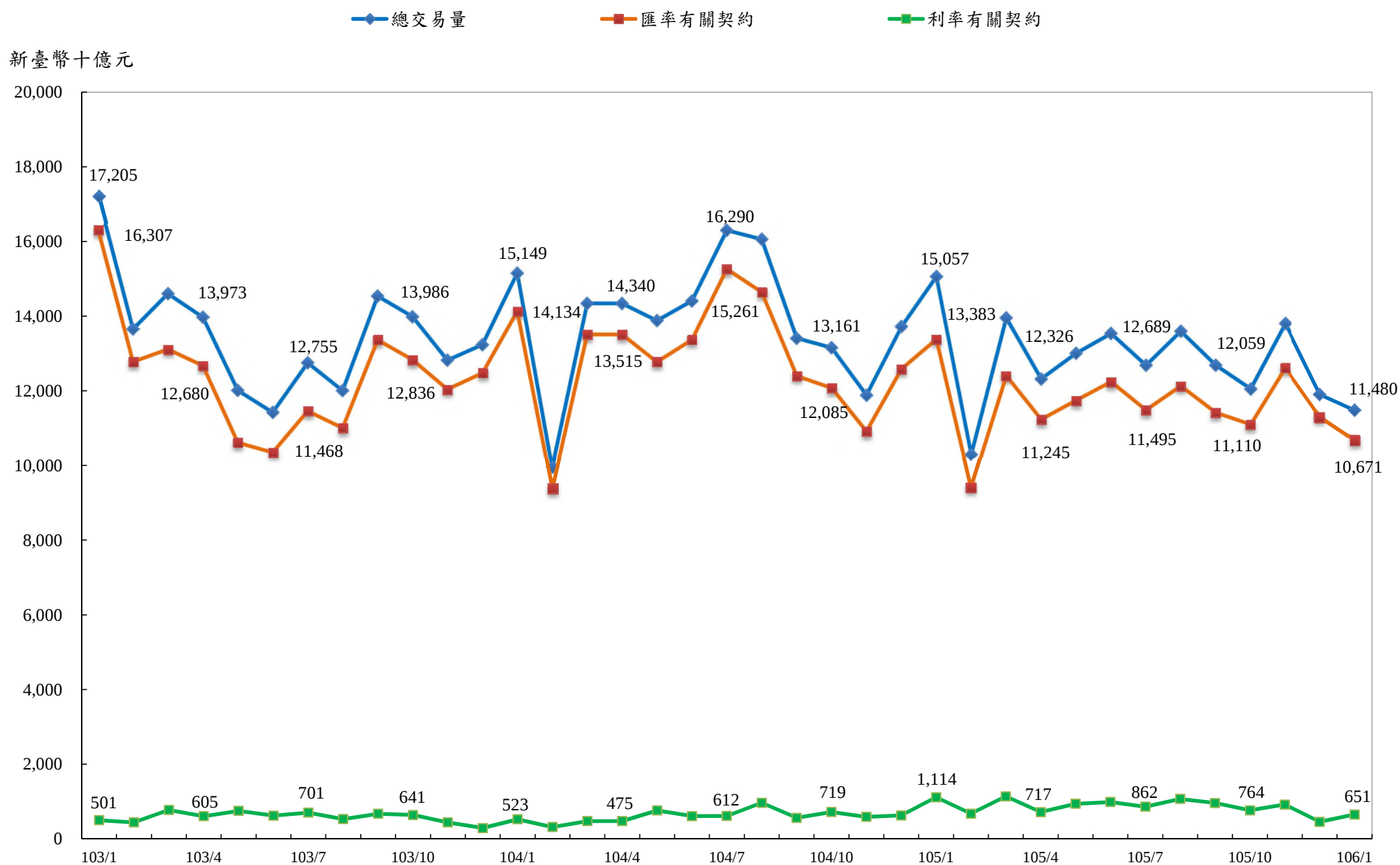
附表2 銀行衍生性金融商品交易量比較表

單位：新臺幣百萬元；%

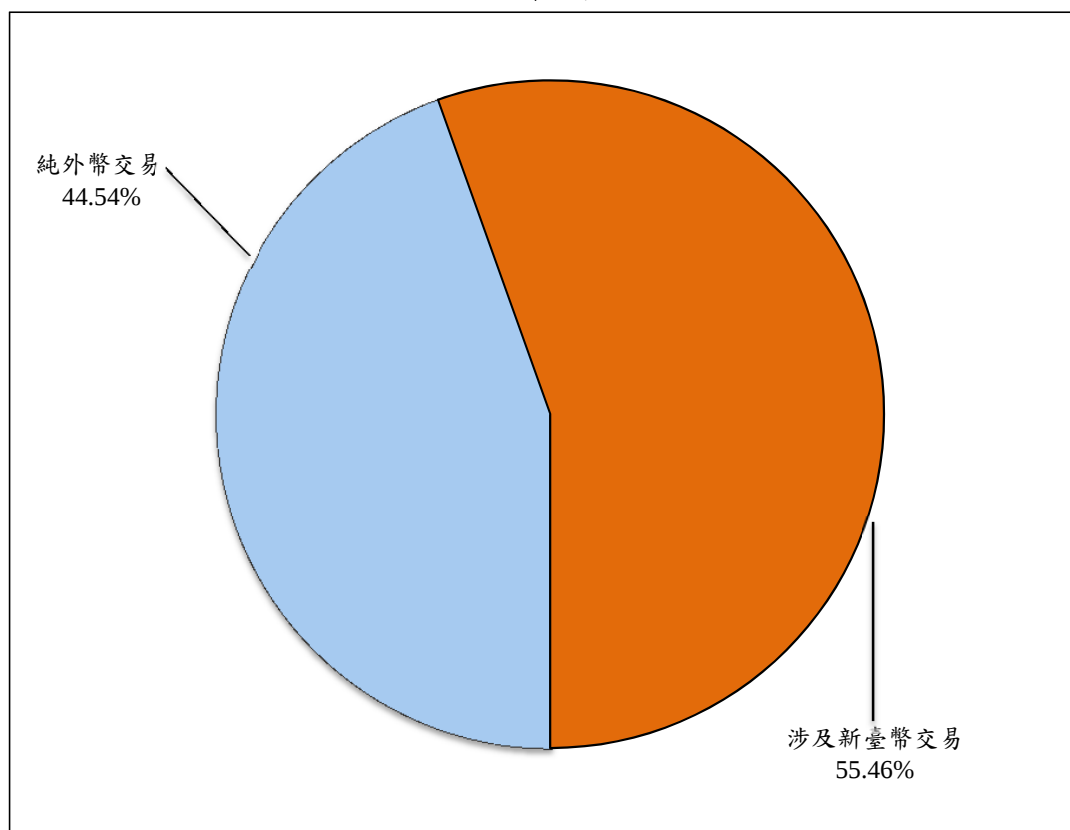
商 品 種 類	106年1月		105年12月		比較增減	
	合計	比重	合計	比重	差 額	變動率
一、利率有關契約(Interest Rate Contracts)	651,143	5.67	454,570	3.82	196,573	43.24
(一)店頭市場(OTC)	335,537	2.92	291,584	2.45	43,953	15.07
1. 遠期利率協議(FRA)	-	-	3,868	0.03	-3,868	-100.00
2. 換利(IRS)	298,364	2.60	275,417	2.31	22,947	8.33
3. 買入選擇權(Bought Options)	94	-	8,163	0.07	-8,069	-98.85
4. 賣出選擇權(Sold Options)	37,079	0.32	4,136	0.04	32,943	796.49
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	315,606	2.75	162,986	1.37	152,620	93.64
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	158,907	1.39	92,246	0.78	66,661	72.26
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	156,073	1.36	69,904	0.59	86,169	123.27
3. 買入選擇權(Bought Options)	220	-	329	-	-109	-33.13
4. 賣出選擇權(Sold Options)	406	-	507	-	-101	-19.92
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	10,671,207	92.96	11,297,489	94.91	-626,282	-5.54
(一)店頭市場(OTC)	10,641,041	92.70	11,206,252	94.14	-565,211	-5.04
1. 遠期契約(Outright Forwards)	1,117,798	9.74	1,222,768	10.27	-104,970	-8.58
2. 換匯(Fx Swaps)	8,789,875	76.57	9,303,849	78.16	-513,974	-5.52
3. 換匯換利(Currency Swaps)	60,999	0.53	132,099	1.11	-71,100	-53.82
4. 買入選擇權(Bought Options)	340,664	2.97	281,776	2.37	58,888	20.90
5. 賣出選擇權(Sold Options)	331,705	2.89	265,760	2.23	65,945	24.81
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	30,166	0.26	91,237	0.77	-61,071	-66.94
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	12,502	0.11	42,048	0.35	-29,546	-70.27
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	12,375	0.11	41,783	0.35	-29,408	-70.38
3. 買入選擇權(Bought Options)	2,871	0.02	4,452	0.04	-1,581	-35.51
4. 賣出選擇權(Sold Options)	2,418	0.02	2,954	0.03	-536	-18.14
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	136,549	1.19	140,436	1.18	-3,887	-2.77
(一)店頭市場(OTC)	956	0.01	540	-	416	77.04
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	135,593	1.18	139,896	1.18	-4,303	-3.08
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	19,056	0.17	9,912	0.08	9,144	92.25
(一)店頭市場(OTC)	9,363	0.08	6,057	0.05	3,306	54.58
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	9,693	0.09	3,855	0.03	5,838	151.44
小 計(一至四)	11,477,955	99.99	11,902,407	99.99	-424,452	-3.57
五、信用有關契約(Credit Contracts)	1,557	0.01	969	0.01	588	60.68
1. 信用違約交換(Credit Default Swap)	1,557	0.01	969	0.01	588	60.68
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	11,479,512	100.00	11,903,376	100.00	-423,864	-3.56

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1月銀行衍生性金融商品交易量內容分析
幣別



銀行類別

