

附表1 銀行衍生性金融商品交易量彙總表

商 品 種 類 別

104年10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)	212, 874	506, 570	719, 444	5. 46
(一)店頭市場(OTC)	212, 874	98, 206	311, 080	2. 36
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	408, 364	408, 364	3. 10
二、匯率有關契約 ² (Foreign Exchange Transactions)	4, 763, 937	7, 321, 508	12, 085, 445	91. 83
(一)店頭市場(OTC)	4, 763, 937	6, 594, 630	11, 358, 567	86. 31
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	726, 878	726, 878	5. 52
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	302, 853	5, 901	308, 754	2. 35
(一)店頭市場(OTC)	35	353	388	-
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	302, 818	5, 548	308, 366	2. 35
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	790	44, 461	45, 251	0. 35
(一)店頭市場(OTC)	-	8, 963	8, 963	0. 07
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	790	35, 498	36, 288	0. 28
小 計(一至四)	5, 280, 454	7, 878, 440	13, 158, 894	99. 99
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	1, 839	1, 839	0. 01
六、其他有關契約(Other Contracts)	-	-	-	-
總 計	5, 280, 454	7, 880, 279	13, 160, 733	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
104年10月	金 額	5, 280, 454	7, 880, 279	13, 160, 733
	比 重	40. 12	59. 88	100. 00
104年9月	金 額	5, 557, 588	7, 854, 353	13, 411, 941
	比 重	41. 44	58. 56	100. 00
比較增減	差 額	-277, 134	25, 926	-251, 208
	變動率	-4. 99	0. 33	-1. 87

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；%

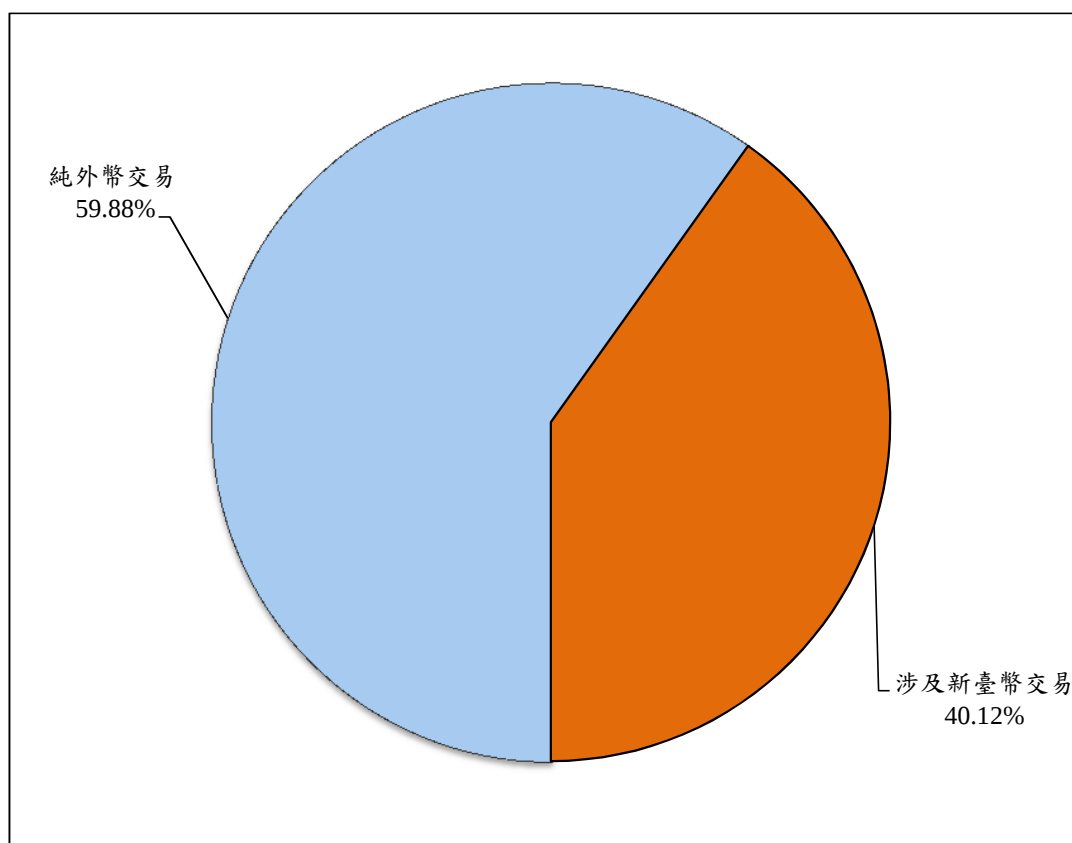
商 品 種 類	104年10月		104年9月		比較增減	
	合計	比重	合計	比重	差 額	變動率
一、利率有關契約(Interest Rate Contracts)	719,444	5.46	563,239	4.20	156,205	27.73
(一)店頭市場(OTC)	311,080	2.36	286,119	2.13	24,961	8.72
1. 遠期利率協議(FRA)	-	-	918	0.01	-918	-100.00
2. 換利(IRS)	305,564	2.32	276,942	2.06	28,622	10.34
3. 買入選擇權(Bought Options)	1,102	0.01	2,052	0.01	-950	-46.30
4. 賣出選擇權(Sold Options)	4,414	0.03	6,207	0.05	-1,793	-28.89
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	408,364	3.10	277,120	2.07	131,244	47.36
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	205,537	1.56	135,980	1.02	69,557	51.15
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	202,826	1.54	141,137	1.05	61,689	43.71
3. 買入選擇權(Bought Options)	1	-	2	-	-1	-50.00
4. 賣出選擇權(Sold Options)	-	-	1	-	-1	-100.00
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	12,085,445	91.83	12,407,145	92.51	-321,700	-2.59
(一)店頭市場(OTC)	11,358,567	86.31	12,114,045	90.32	-755,478	-6.24
1. 遠期契約(Outright Forwards)	1,077,487	8.19	1,194,265	8.90	-116,778	-9.78
2. 換匯(Fx Swaps)	8,283,112	62.94	9,101,010	67.86	-817,898	-8.99
3. 換匯換利(Currency Swaps)	105,121	0.80	70,476	0.53	34,645	49.16
4. 買入選擇權(Bought Options)	965,680	7.34	916,233	6.83	49,447	5.40
5. 賣出選擇權(Sold Options)	927,167	7.04	832,061	6.20	95,106	11.43
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	726,878	5.52	293,100	2.19	433,778	148.00
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	363,340	2.76	143,938	1.08	219,402	152.43
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	363,538	2.76	149,162	1.11	214,376	143.72
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)	308,754	2.35	400,052	2.98	-91,298	-22.82
(一)店頭市場(OTC)	388	-	247	-	141	57.09
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	308,366	2.35	399,805	2.98	-91,439	-22.87
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	45,251	0.35	37,726	0.28	7,525	19.95
(一)店頭市場(OTC)	8,963	0.07	12,256	0.09	-3,293	-26.87
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	36,288	0.28	25,470	0.19	10,818	42.47
小 計(一至四)	13,158,894	99.99	13,408,162	99.97	-249,268	-1.86
五、信用有關契約(Credit Contracts)	1,839	0.01	3,779	0.03	-1,940	-51.34
1. 信用違約交換(Credit Default Swap)	1,839	0.01	3,779	0.03	-1,940	-51.34
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	13,160,733	100.00	13,411,941	100.00	-251,208	-1.87

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2 104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

