

# 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8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 <sup>1</sup> |            |            |        |
|-------------------------------------------------------|----------------------------|------------|------------|--------|
|                                                       | 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)                     | 271,684                    | 693,192    | 964,876    | 6.01   |
| (一)店頭市場(OTC)                                          | 271,684                    | 254,124    | 525,808    | 3.28   |
| (二)交易所(Exchange-traded Contracts)                     | -                          | 439,068    | 439,068    | 2.73   |
| 二、匯率有關契約 <sup>2</sup> (Foreign Exchange Transactions) | 5,219,098                  | 9,421,212  | 14,640,310 | 91.19  |
| (一)店頭市場(OTC)                                          | 5,219,098                  | 9,004,164  | 14,223,262 | 88.59  |
| (二)交易所(Exchange-traded Contracts)                     | -                          | 417,048    | 417,048    | 2.60   |
| 三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)                   | 414,356                    | 8,483      | 422,839    | 2.64   |
| (一)店頭市場(OTC)                                          | 102                        | 257        | 359        | -      |
| (二)交易所(Exchange-traded Contracts)                     | 414,254                    | 8,226      | 422,480    | 2.64   |
| 四、商品有關契約(Commodity Contracts)                         | 1,295                      | 19,725     | 21,020     | 0.13   |
| (一)店頭市場(OTC)                                          | -                          | 12,699     | 12,699     | 0.08   |
| (二)交易所(Exchange-traded Contracts)                     | 1,295                      | 7,026      | 8,321      | 0.05   |
| 小 計(一至四)                                              | 5,906,433                  | 10,142,612 | 16,049,045 | 99.97  |
| 五、信用有關契約(Credit Contracts)                            | -                          | 5,496      | 5,496      | 0.03   |
| 六、其他有關契約(Other Contracts)                             | -                          | -          | -          | -      |
| 總 計                                                   | 5,906,433                  | 10,148,108 | 16,054,541 | 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8月  | 金 額 | 5,906,433 | 10,148,108 | 16,054,541 |
|         | 比 重 | 36.79     | 63.21      | 100.00     |
| 104年7月  | 金 額 | 5,918,980 | 10,370,624 | 16,289,604 |
|         | 比 重 | 36.34     | 63.66      | 100.00     |
| 比較增減    | 差 額 | -12,547   | -222,516   | -235,063   |
|         | 變動率 | -0.21     | -2.15      | -1.44      |

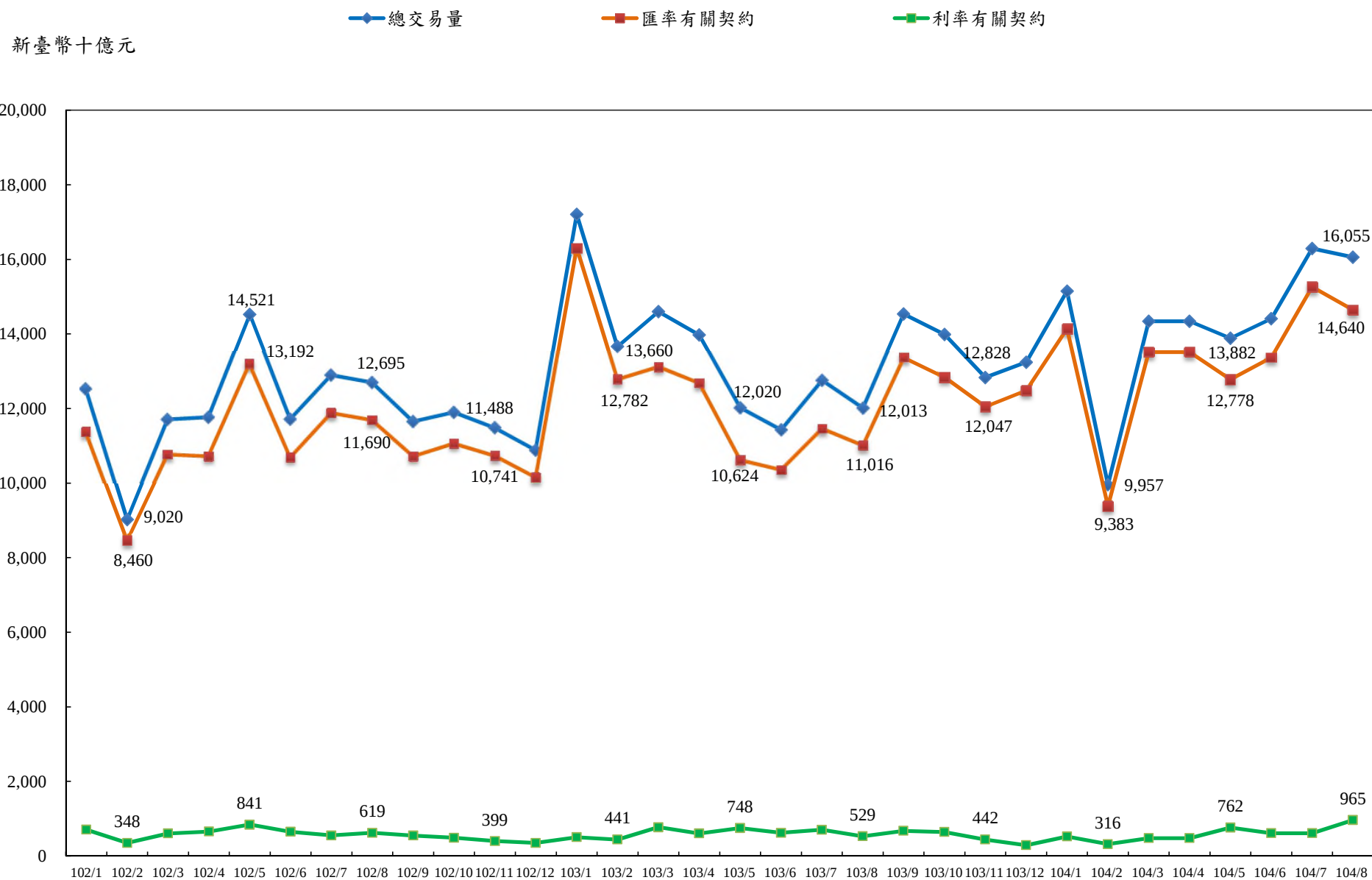
附表2 銀行衍生性金融商品交易量比較表

單位：新臺幣百萬元；%

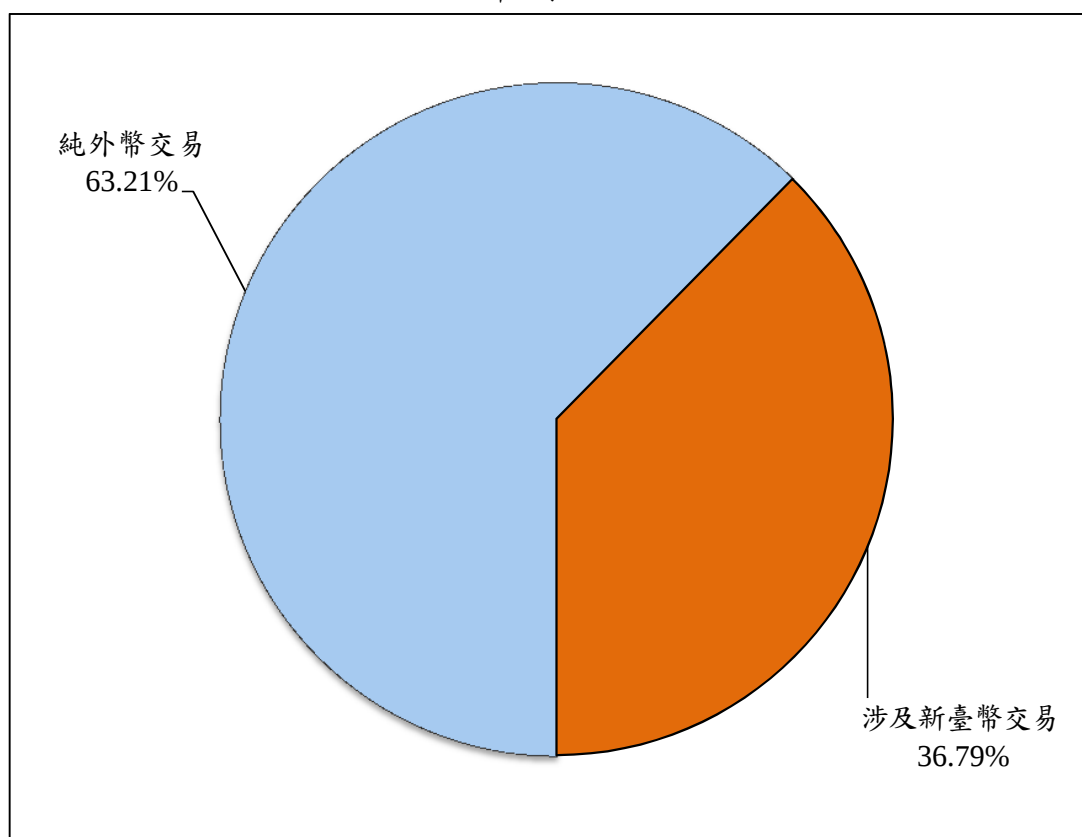
| 商 品 種 類                                        | 104年8月     |        | 104年7月     |        | 比較增減     |        |
|------------------------------------------------|------------|--------|------------|--------|----------|--------|
|                                                | 合計         | 比重     | 合計         | 比重     | 差 額      | 變動率    |
| <b>一、利率有關契約(Interest Rate Contracts)</b>       | 964,876    | 6.01   | 612,321    | 3.76   | 352,555  | 57.58  |
| (一)店頭市場(OTC)                                   | 525,808    | 3.28   | 277,016    | 1.70   | 248,792  | 89.81  |
| 1.遠期利率協議(FRA)                                  | 65,616     | 0.41   | -          | -      | 65,616   | -      |
| 2.換利(IRS)                                      | 447,579    | 2.79   | 264,716    | 1.62   | 182,863  | 69.08  |
| 3.買入選擇權(Bought Options)                        | 1,848      | 0.01   | 1,033      | 0.01   | 815      | 78.90  |
| 4.賣出選擇權(Sold Options)                          | 10,765     | 0.07   | 11,267     | 0.07   | -502     | -4.46  |
| (二)交易所(Exchange-traded Contracts)              | 439,068    | 2.73   | 335,305    | 2.06   | 103,763  | 30.95  |
| 1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)             | 223,249    | 1.39   | 163,036    | 1.00   | 60,213   | 36.93  |
| 2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)            | 215,160    | 1.34   | 168,741    | 1.04   | 46,419   | 27.51  |
| 3.買入選擇權(Bought Options)                        | 658        | -      | 1,468      | 0.01   | -810     | -55.18 |
| 4.賣出選擇權(Sold Options)                          | 1          | -      | 2,060      | 0.01   | -2,059   | -99.95 |
| <b>二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)</b> | 14,640,310 | 91.19  | 15,260,742 | 93.68  | -620,432 | -4.07  |
| (一)店頭市場(OTC)                                   | 14,223,262 | 88.59  | 15,154,412 | 93.03  | -931,150 | -6.14  |
| 1.遠期契約(Outright Forwards)                      | 1,833,566  | 11.42  | 1,471,737  | 9.04   | 361,829  | 24.59  |
| 2.換匯(Fx Swaps)                                 | 9,782,424  | 60.93  | 9,615,824  | 59.03  | 166,600  | 1.73   |
| 3.換匯換利(Currency Swaps)                         | 73,610     | 0.46   | 99,852     | 0.61   | -26,242  | -26.28 |
| 4.買入選擇權(Bought Options)                        | 1,282,325  | 7.99   | 2,031,958  | 12.47  | -749,633 | -36.89 |
| 5.賣出選擇權(Sold Options)                          | 1,251,337  | 7.79   | 1,935,041  | 11.88  | -683,704 | -35.33 |
| (二)交易所(Exchange-traded Contracts)              | 417,048    | 2.60   | 106,330    | 0.65   | 310,718  | 292.22 |
| 1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)             | 208,419    | 1.30   | 53,209     | 0.33   | 155,210  | 291.70 |
| 2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)            | 208,629    | 1.30   | 53,121     | 0.32   | 155,508  | 292.74 |
| 3.買入選擇權(Bought Options)                        | -          | -      | -          | -      | -        | -      |
| 4.賣出選擇權(Sold Options)                          | -          | -      | -          | -      | -        | -      |
| <b>三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)</b>     | 422,839    | 2.64   | 370,723    | 2.28   | 52,116   | 14.06  |
| (一)店頭市場(OTC)                                   | 359        | -      | 1,835      | 0.01   | -1,476   | -80.44 |
| (二)交易所(Exchange-traded Contracts)              | 422,480    | 2.64   | 368,888    | 2.27   | 53,592   | 14.53  |
| <b>四、商品有關契約(Commodity Contracts)</b>           | 21,020     | 0.13   | 43,996     | 0.27   | -22,976  | -52.22 |
| (一)店頭市場(OTC)                                   | 12,699     | 0.08   | 20,005     | 0.12   | -7,306   | -36.52 |
| (二)交易所(Exchange-traded Contracts)              | 8,321      | 0.05   | 23,991     | 0.15   | -15,670  | -65.32 |
| 小 計(一至四)                                       | 16,049,045 | 99.97  | 16,287,782 | 99.99  | -238,737 | -1.47  |
| <b>五、信用有關契約(Credit Contracts)</b>              | 5,496      | 0.03   | 1,822      | 0.01   | 3,674    | 201.65 |
| 1.信用違約交換(Credit Default Swap)                  | 5,496      | 0.03   | 1,822      | 0.01   | 3,674    | 201.65 |
| 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)                                    | -          | -      | -          | -      | -        | -      |
| <b>六、其他有關契約(Other Contracts)</b>               | -          | -      | -          | -      | -        | -      |
| 1.遠期契約(Outright Forwards)                      | -          | -      | -          | -      | -        | -      |
| 2.交換(Swaps)                                    | -          | -      | -          | -      | -        | -      |
| 3.選擇權(Options)                                 | -          | -      | -          | -      | -        | -      |
| 總 計 <sup>註</sup>                               | 16,054,541 | 100.00 | 16,289,604 | 100.00 | -235,063 | -1.44  |

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8月銀行衍生性金融商品交易量內容分析  
幣別



銀行類別

