

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8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)	188,880	880,063	1,068,943	7.86
（一）店頭市場(OTC)	188,880	150,742	339,622	2.50
（二）交易所(Exchange-traded Contracts)	-	729,321	729,321	5.36
二、匯率有關契約 ² (Foreign Exchange Transactions)	5,399,086	6,740,452	12,139,538	89.27
（一）店頭市場(OTC)	5,399,086	6,591,581	11,990,667	88.17
（二）交易所(Exchange-traded Contracts)	-	148,871	148,871	1.10
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	370,317	5,614	375,931	2.76
（一）店頭市場(OTC)	301	349	650	-
（二）交易所(Exchange-traded Contracts)	370,016	5,265	375,281	2.76
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	747	12,793	13,540	0.10
（一）店頭市場(OTC)	-	9,936	9,936	0.07
（二）交易所(Exchange-traded Contracts)	747	2,857	3,604	0.03
小 計(一至四)	5,959,030	7,638,922	13,597,952	99.99
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	1,375	1,375	0.01
六、其他有關契約(Other Contracts)	-	-	-	-
總 計	5,959,030	7,640,297	13,599,327	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8月	金 額	5,959,030	7,640,297	13,599,327
	比 重	43.82	56.18	100.00
105年7月	金 額	5,942,231	6,746,461	12,688,692
	比 重	46.83	53.17	100.00
比較增減	差 額	16,799	893,836	910,635
	變動率	0.28	13.25	7.18

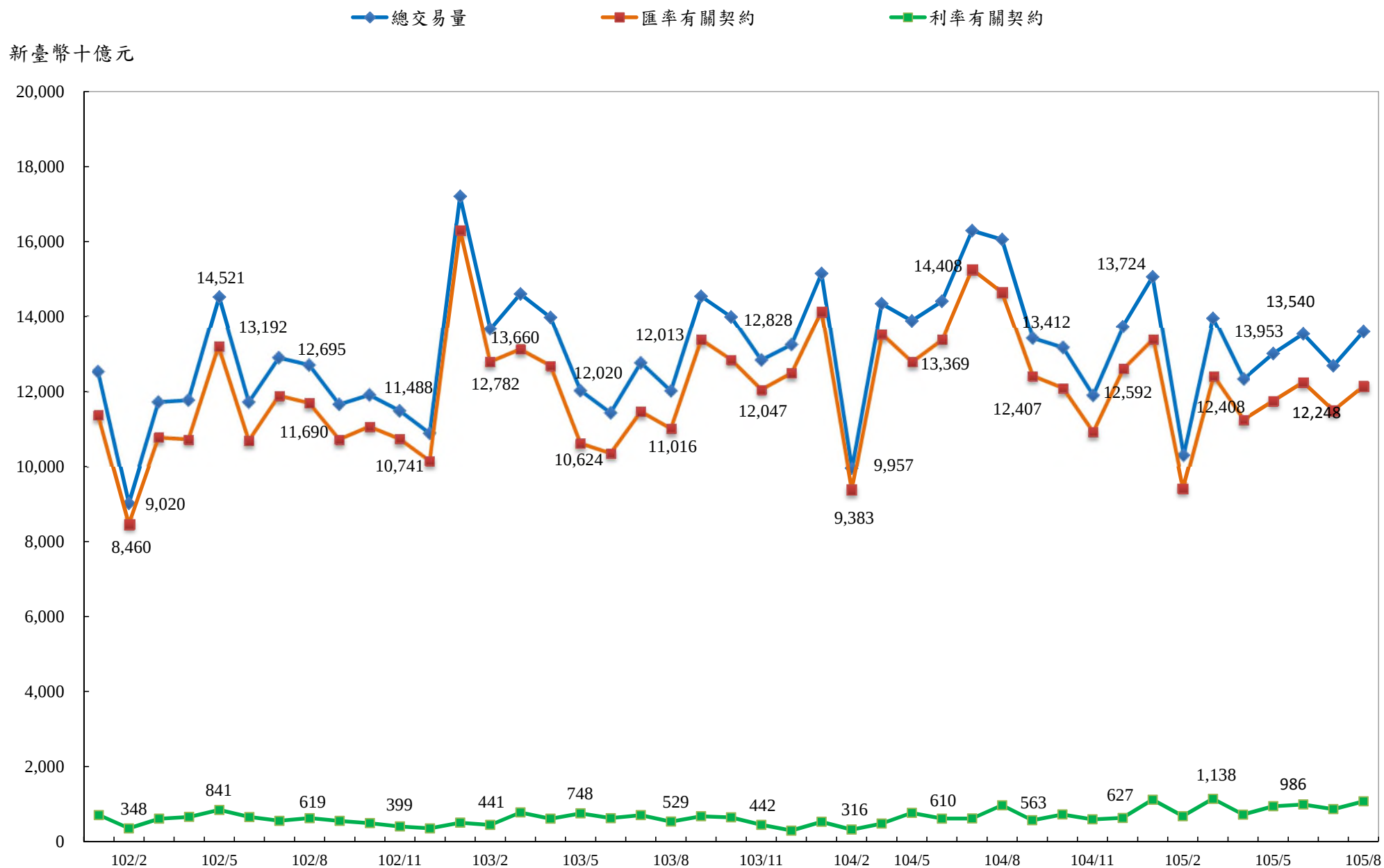
附表2 銀行衍生性金融商品交易量比較表

單位：新臺幣百萬元；%

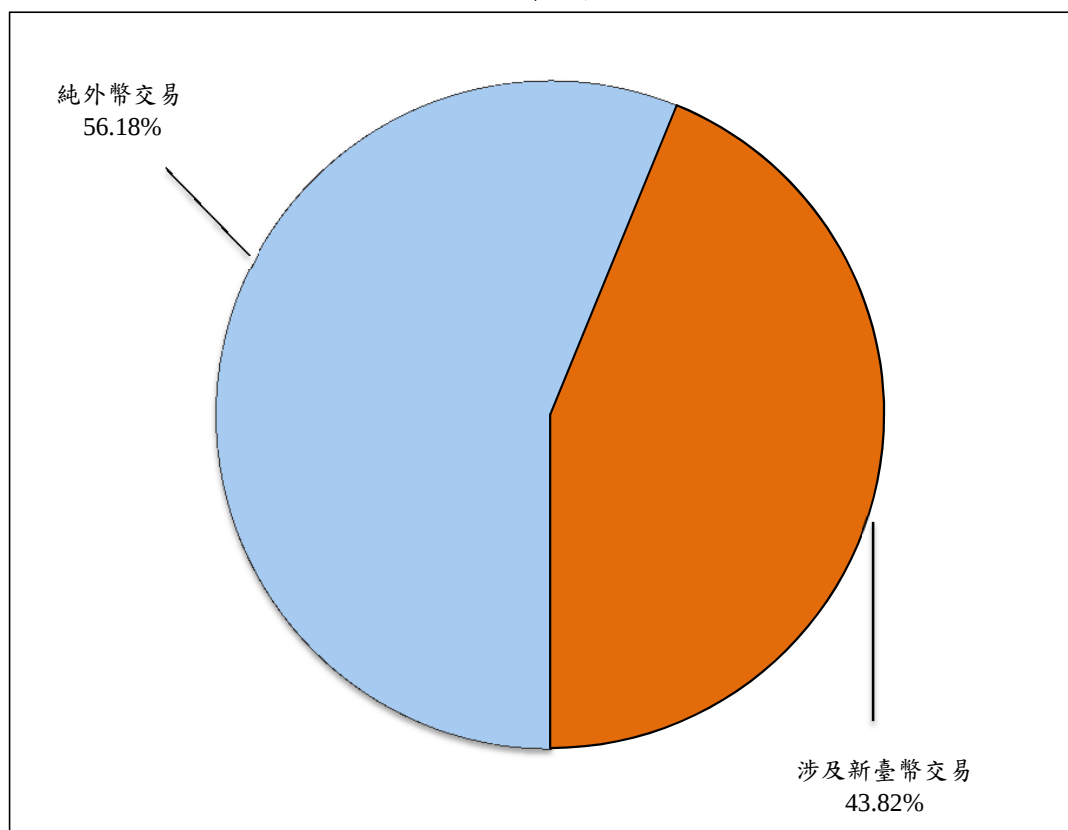
商 品 種 類	105年8月		105年7月		比較增減	
	合計	比重	合計	比重	差 額	變動率
一、利率有關契約(Interest Rate Contracts)	1,068,943	7.86	862,180	6.79	206,763	23.98
(一)店頭市場(OTC)	339,622	2.50	379,671	2.99	-40,049	-10.55
1. 遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-	-	-
2. 換利(IRS)	326,373	2.40	362,629	2.86	-36,256	-10.00
3. 買入選擇權(Bought Options)	2,714	0.02	3,666	0.03	-952	-25.97
4. 賣出選擇權(Sold Options)	10,535	0.08	13,376	0.10	-2,841	-21.24
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	729,321	5.36	482,509	3.80	246,812	51.15
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	335,750	2.47	283,474	2.23	52,276	18.44
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	393,571	2.89	199,035	1.57	194,536	97.74
3. 買入選擇權(Bought Options)	-	-	-	-	-	-
4. 賣出選擇權(Sold Options)	-	-	-	-	-	-
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	12,139,538	89.27	11,495,426	90.60	644,112	5.60
(一)店頭市場(OTC)	11,990,667	88.17	11,349,780	89.45	640,887	5.65
1. 遠期契約(Outright Forwards)	1,261,961	9.28	1,202,047	9.47	59,914	4.98
2. 換匯(Fx Swaps)	9,794,276	72.02	9,107,274	71.77	687,002	7.54
3. 換匯換利(Currency Swaps)	54,792	0.40	72,208	0.57	-17,416	-24.12
4. 買入選擇權(Bought Options)	443,980	3.27	486,636	3.84	-42,656	-8.77
5. 賣出選擇權(Sold Options)	435,658	3.20	481,615	3.80	-45,957	-9.54
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	148,871	1.10	145,646	1.15	3,225	2.21
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	39,561	0.29	43,712	0.34	-4,151	-9.50
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	38,243	0.28	44,169	0.35	-5,926	-13.42
3. 買入選擇權(Bought Options)	36,335	0.27	29,072	0.23	7,263	24.98
4. 賣出選擇權(Sold Options)	34,732	0.26	28,693	0.23	6,039	21.05
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	375,931	2.76	311,818	2.46	64,113	20.56
(一)店頭市場(OTC)	650	-	761	0.01	-111	-14.59
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	375,281	2.76	311,057	2.45	64,224	20.65
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	13,540	0.10	17,566	0.14	-4,026	-22.92
(一)店頭市場(OTC)	9,936	0.07	9,169	0.07	767	8.37
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	3,604	0.03	8,397	0.07	-4,793	-57.08
小 計(一至四)	13,597,952	99.99	12,686,990	99.99	910,962	7.18
五、信用有關契約(Credit Contracts)	1,375	0.01	1,702	0.01	-327	-19.21
1. 信用違約交換(Credit Default Swap)	1,375	0.01	1,702	0.01	-327	-19.21
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	13,599,327	100.00	12,688,692	100.00	910,635	7.18

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8月銀行衍生性金融商品交易量內容分析
幣別



銀行類別

