

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6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)	190,322	1,038,912	1,229,234	9.42
（一）店頭市場(OTC)	189,823	154,526	344,349	2.64
（二）交易所(Exchange-traded Contracts)	499	884,386	884,885	6.78
二、匯率有關契約²(Foreign Exchange Transactions)	5,872,624	5,266,051	11,138,675	85.39
（一）店頭市場(OTC)	5,872,624	5,204,617	11,077,241	84.92
（二）交易所(Exchange-traded Contracts)	-	61,434	61,434	0.47
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	655,258	6,042	661,300	5.07
（一）店頭市場(OTC)	-	388	388	-
（二）交易所(Exchange-traded Contracts)	655,258	5,654	660,912	5.07
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	803	9,892	10,695	0.08
（一）店頭市場(OTC)	-	7,223	7,223	0.05
（二）交易所(Exchange-traded Contracts)	803	2,669	3,472	0.03
小 計(一至四)	6,719,007	6,320,897	13,039,904	99.96
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	4,729	4,729	0.04
六、其他有關契約(Other Contracts)	-	-	-	-
總 計	6,719,007	6,325,626	13,044,633	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6月	金 額	6,719,007	6,325,626	13,044,633
	比 重	51.51	48.49	100.00
106年5月	金 額	6,209,433	5,491,756	11,701,189
	比 重	53.07	46.93	100.00
比較增減	差 額	509,574	833,870	1,343,444
	變動率	8.21	15.18	11.48

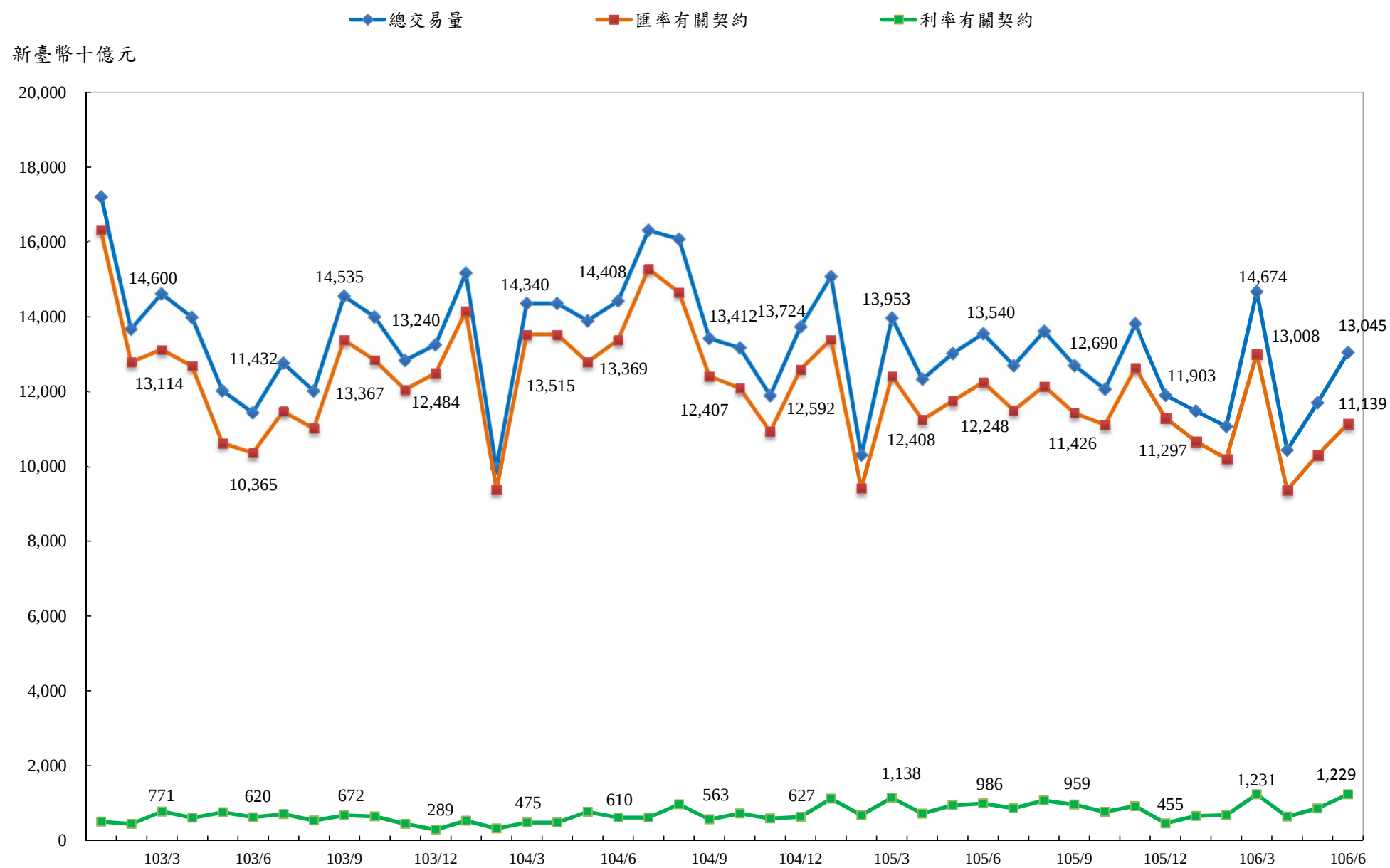
附表2 銀行衍生性金融商品交易量比較表

單位：新臺幣百萬元；%

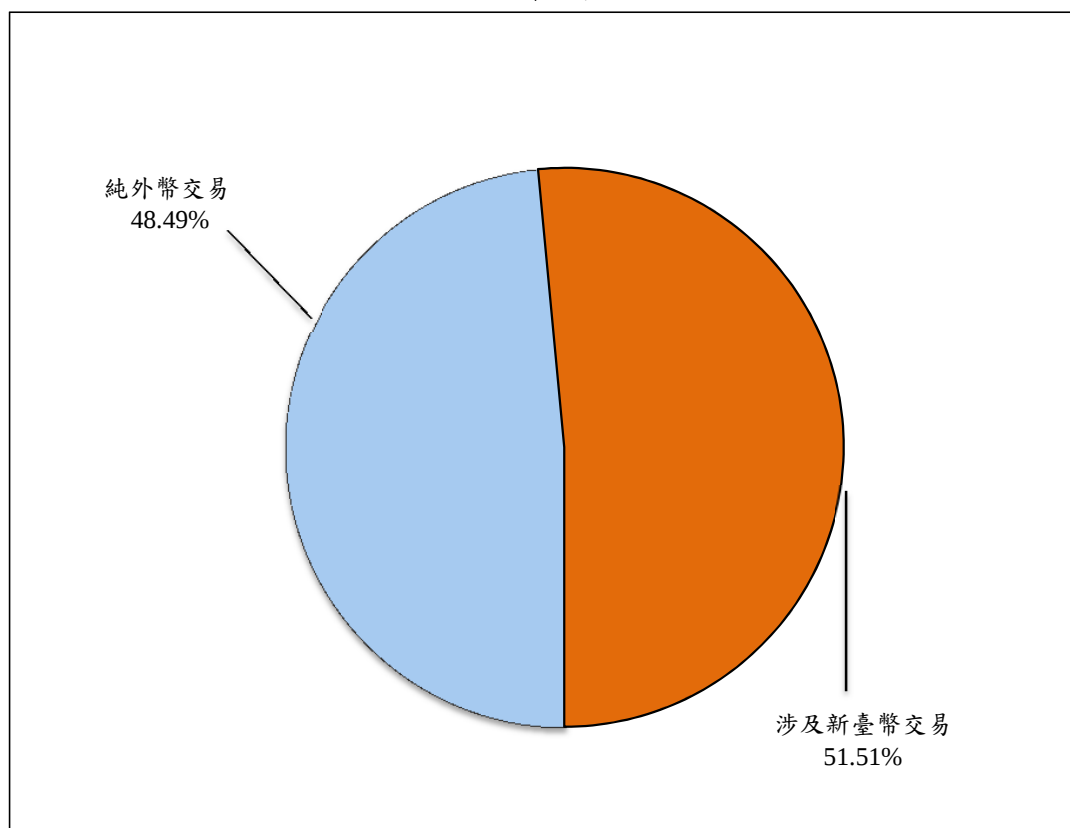
商 品 種 類	106年6月		106年5月		比較增減	
	合計	比重	合計	比重	差 額	變動率
一、利率有關契約(Interest Rate Contracts)	1,229,234	9.42	856,539	7.32	372,695	43.51
(一)店頭市場(OTC)	344,349	2.64	259,647	2.22	84,702	32.62
1.遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-	-	-
2.換利(IRS)	328,612	2.52	234,987	2.01	93,625	39.84
3.買入選擇權(Bought Options)	517	-	-	-	517	-
4.賣出選擇權(Sold Options)	15,220	0.12	24,660	0.21	-9,440	-38.28
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	884,885	6.78	596,892	5.10	287,993	48.25
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	437,599	3.36	302,737	2.59	134,862	44.55
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	446,361	3.42	293,503	2.51	152,858	52.08
3.買入選擇權(Bought Options)	426	-	301	-	125	41.53
4.賣出選擇權(Sold Options)	499	-	351	-	148	42.17
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	11,138,675	85.39	10,308,851	88.10	829,824	8.05
(一)店頭市場(OTC)	11,077,241	84.92	10,260,286	87.69	816,955	7.96
1.遠期契約(Outright Forwards)	1,163,859	8.92	1,009,247	8.63	154,612	15.32
2.換匯(Fx Swaps)	9,064,024	69.49	8,578,042	73.31	485,982	5.67
3.換匯換利(Currency Swaps)	174,218	1.34	66,466	0.57	107,752	162.12
4.買入選擇權(Bought Options)	348,576	2.67	308,300	2.63	40,276	13.06
5.賣出選擇權(Sold Options)	326,564	2.50	298,231	2.55	28,333	9.50
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	61,434	0.47	48,565	0.41	12,869	26.50
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	23,476	0.18	19,279	0.16	4,197	21.77
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	23,654	0.18	19,590	0.17	4,064	20.75
3.買入選擇權(Bought Options)	7,613	0.06	5,151	0.04	2,462	47.80
4.賣出選擇權(Sold Options)	6,691	0.05	4,545	0.04	2,146	47.22
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	661,300	5.07	522,410	4.47	138,890	26.59
(一)店頭市場(OTC)	388	-	42	-	346	823.81
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	660,912	5.07	522,368	4.47	138,544	26.52
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	10,695	0.08	9,734	0.08	961	9.87
(一)店頭市場(OTC)	7,223	0.05	7,078	0.06	145	2.05
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	3,472	0.03	2,656	0.02	816	30.72
小 計(一至四)	13,039,904	99.96	11,697,534	99.97	1,342,370	11.48
五、信用有關契約(Credit Contracts)	4,729	0.04	3,655	0.03	1,074	29.38
1.信用違約交換(Credit Default Swap)	4,729	0.04	3,655	0.03	1,074	29.38
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	13,044,633	100.00	11,701,189	100.00	1,343,444	11.48

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6月銀行衍生性金融商品交易量內容分析
幣別



銀行類別

