

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7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)	262, 836	599, 344	862, 180	6. 79
（一）店頭市場(OTC)	262, 836	116, 835	379, 671	2. 99
（二）交易所(Exchange-traded Contracts)	-	482, 509	482, 509	3. 80
二、匯率有關契約²(Foreign Exchange Transactions)	5, 373, 752	6, 121, 674	11, 495, 426	90. 60
（一）店頭市場(OTC)	5, 373, 752	5, 976, 028	11, 349, 780	89. 45
（二）交易所(Exchange-traded Contracts)	-	145, 646	145, 646	1. 15
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	304, 688	7, 130	311, 818	2. 46
（一）店頭市場(OTC)	-	761	761	0. 01
（二）交易所(Exchange-traded Contracts)	304, 688	6, 369	311, 057	2. 45
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	955	16, 611	17, 566	0. 14
（一）店頭市場(OTC)	-	9, 169	9, 169	0. 07
（二）交易所(Exchange-traded Contracts)	955	7, 442	8, 397	0. 07
小 計(一至四)	5, 942, 231	6, 744, 759	12, 686, 990	99. 99
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	1, 702	1, 702	0. 01
六、其他有關契約(Other Contracts)	-	-	-	-
總 計	5, 942, 231	6, 746, 461	12, 688, 692	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7月	金 額	5, 942, 231	6, 746, 461	12, 688, 692
	比 重	46. 83	53. 17	100. 00
105年6月	金 額	5, 971, 707	7, 568, 672	13, 540, 379
	比 重	44. 10	55. 90	100. 00
比較增減	差 額	-29, 476	-822, 211	-851, 687
	變動率	-0. 49	-10. 86	-6. 29

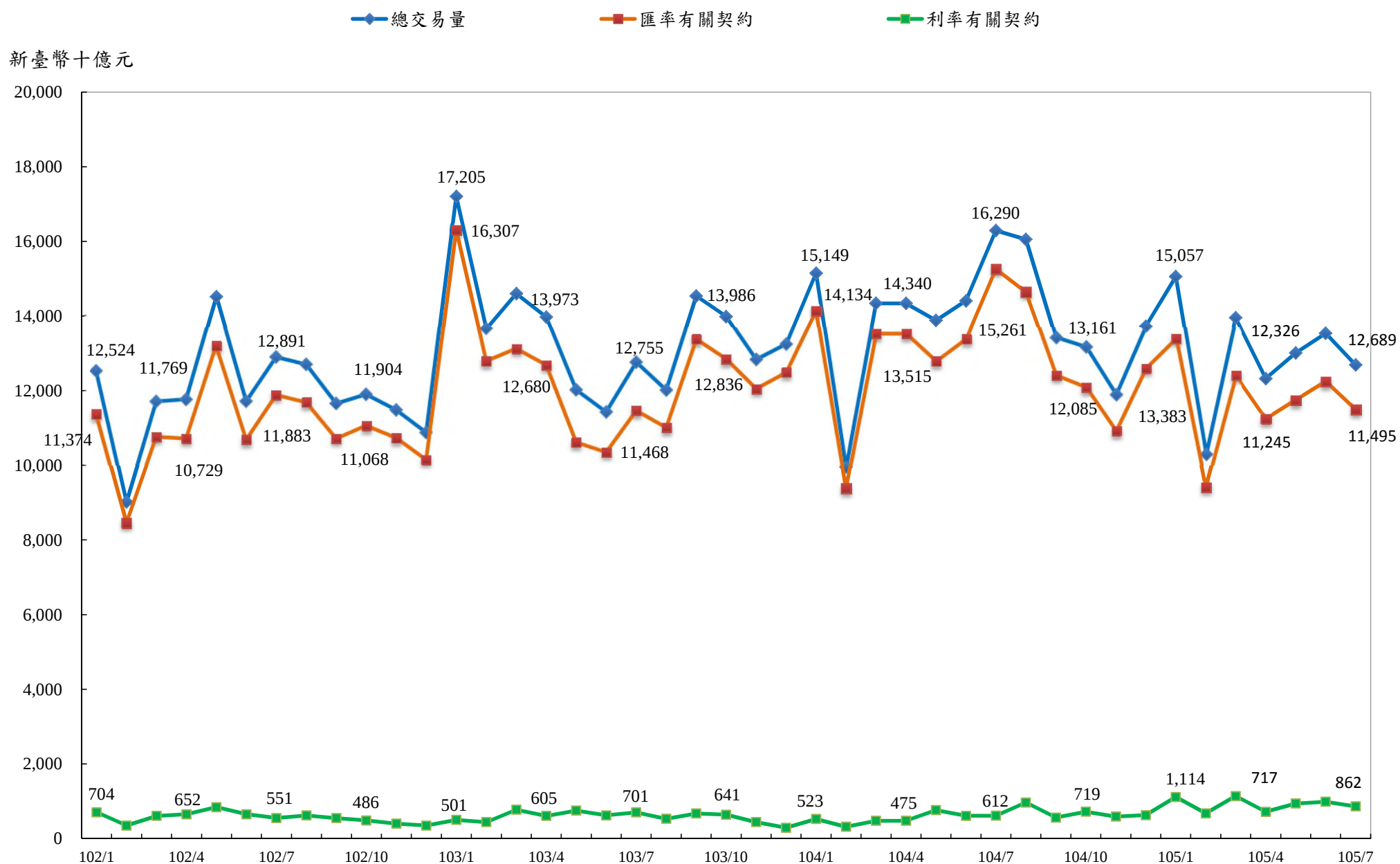
附表2 銀行衍生性金融商品交易量比較表

單位：新臺幣百萬元；%

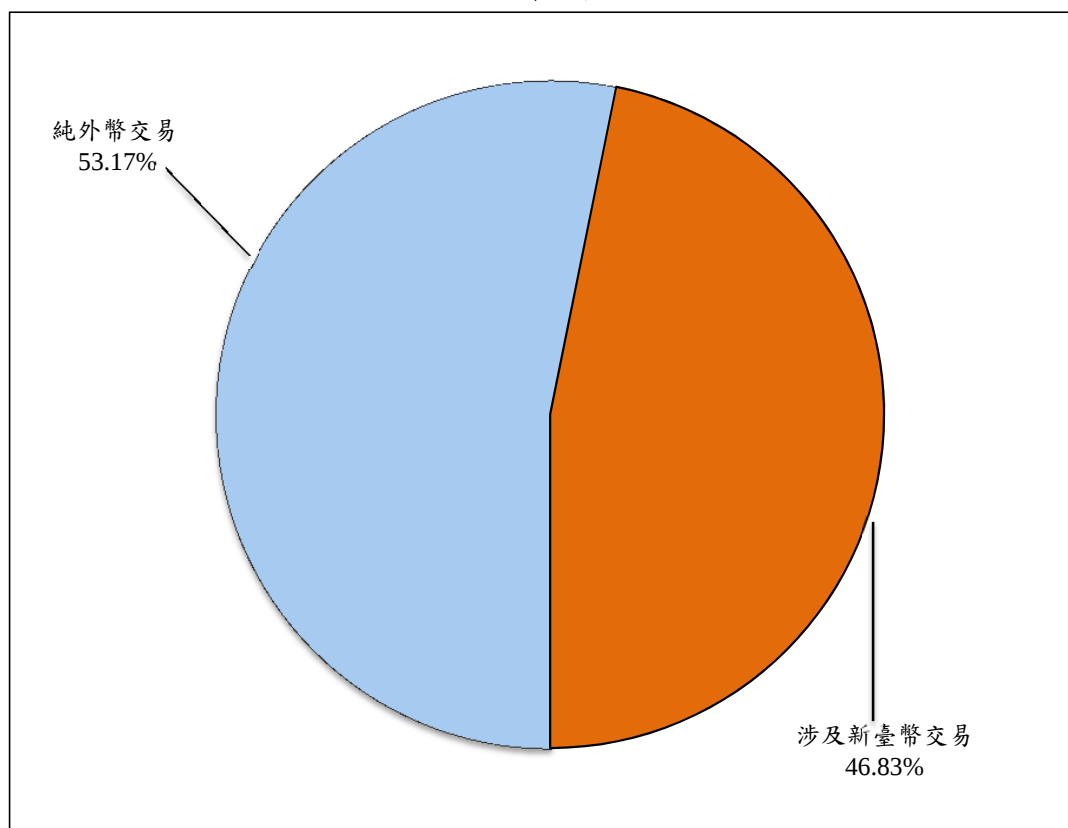
商 品 種 類	105年7月		105年6月		比較增減	
	合計	比重	合計	比重	差 額	變動率
一、利率有關契約(Interest Rate Contracts)	862,180	6.79	986,283	7.29	-124,103	-12.58
(一)店頭市場(OTC)	379,671	2.99	368,289	2.72	11,382	3.09
1. 遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-	-	-
2. 換利(IRS)	362,629	2.86	331,607	2.45	31,022	9.36
3. 買入選擇權(Bought Options)	3,666	0.03	3,467	0.03	199	5.74
4. 賣出選擇權(Sold Options)	13,376	0.10	33,215	0.24	-19,839	-59.73
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	482,509	3.80	617,994	4.57	-135,485	-21.92
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	283,474	2.23	289,178	2.14	-5,704	-1.97
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	199,035	1.57	326,391	2.41	-127,356	-39.02
3. 買入選擇權(Bought Options)	-	-	1,221	0.01	-1,221	-100.00
4. 賣出選擇權(Sold Options)	-	-	1,204	0.01	-1,204	-100.00
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	11,495,426	90.60	12,247,744	90.45	-752,318	-6.14
(一)店頭市場(OTC)	11,349,780	89.45	12,155,205	89.77	-805,425	-6.63
1. 遠期契約(Outright Forwards)	1,202,047	9.47	1,205,761	8.90	-3,714	-0.31
2. 換匯(Fx Swaps)	9,107,274	71.77	9,850,029	72.75	-742,755	-7.54
3. 換匯換利(Currency Swaps)	72,208	0.57	205,954	1.52	-133,746	-64.94
4. 買入選擇權(Bought Options)	486,636	3.84	450,623	3.33	36,013	7.99
5. 賣出選擇權(Sold Options)	481,615	3.80	442,838	3.27	38,777	8.76
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	145,646	1.15	92,539	0.68	53,107	57.39
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	43,712	0.34	45,491	0.33	-1,779	-3.91
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	44,169	0.35	45,170	0.33	-1,001	-2.22
3. 買入選擇權(Bought Options)	29,072	0.23	982	0.01	28,090	2,860.49
4. 賣出選擇權(Sold Options)	28,693	0.23	896	0.01	27,797	3,102.34
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	311,818	2.46	291,484	2.15	20,334	6.98
(一)店頭市場(OTC)	761	0.01	1,051	0.01	-290	-27.59
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	311,057	2.45	290,433	2.14	20,624	7.10
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	17,566	0.14	12,984	0.10	4,582	35.29
(一)店頭市場(OTC)	9,169	0.07	8,748	0.07	421	4.81
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	8,397	0.07	4,236	0.03	4,161	98.23
小 計(一至四)	12,686,990	99.99	13,538,495	99.99	-851,505	-6.29
五、信用有關契約(Credit Contracts)	1,702	0.01	1,884	0.01	-182	-9.66
1. 信用違約交換(Credit Default Swap)	1,702	0.01	1,884	0.01	-182	-9.66
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	12,688,692	100.00	13,540,379	100.00	-851,687	-6.29

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7月銀行衍生性金融商品交易量內容分析
幣別



銀行類別

