

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3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)	286,698	944,328	1,231,026	8.39
（一）店頭市場(OTC)	286,615	236,651	523,266	3.57
（二）交易所(Exchange-traded Contracts)	83	707,677	707,760	4.82
二、匯率有關契約²(Foreign Exchange Transactions)	7,115,926	5,892,099	13,008,025	88.65
（一）店頭市場(OTC)	7,115,926	5,834,111	12,950,037	88.25
（二）交易所(Exchange-traded Contracts)	-	57,988	57,988	0.40
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	413,127	3,249	416,376	2.84
（一）店頭市場(OTC)	-	430	430	-
（二）交易所(Exchange-traded Contracts)	413,127	2,819	415,946	2.84
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	704	14,584	15,288	0.10
（一）店頭市場(OTC)	-	11,332	11,332	0.08
（二）交易所(Exchange-traded Contracts)	704	3,252	3,956	0.02
小 計(一至四)	7,816,455	6,854,260	14,670,715	99.98
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	3,419	3,419	0.02
六、其他有關契約(Other Contracts)	-	-	-	-
總 計	7,816,455	6,857,679	14,674,134	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3月	金 額	7,816,455	6,857,679	14,674,134
	比 重	53.27	46.73	100.00
106年2月	金 額	6,055,155	5,013,438	11,068,593
	比 重	54.71	45.29	100.00
比較增減	差 額	1,761,300	1,844,241	3,605,541
	變動率	29.09	36.79	32.57

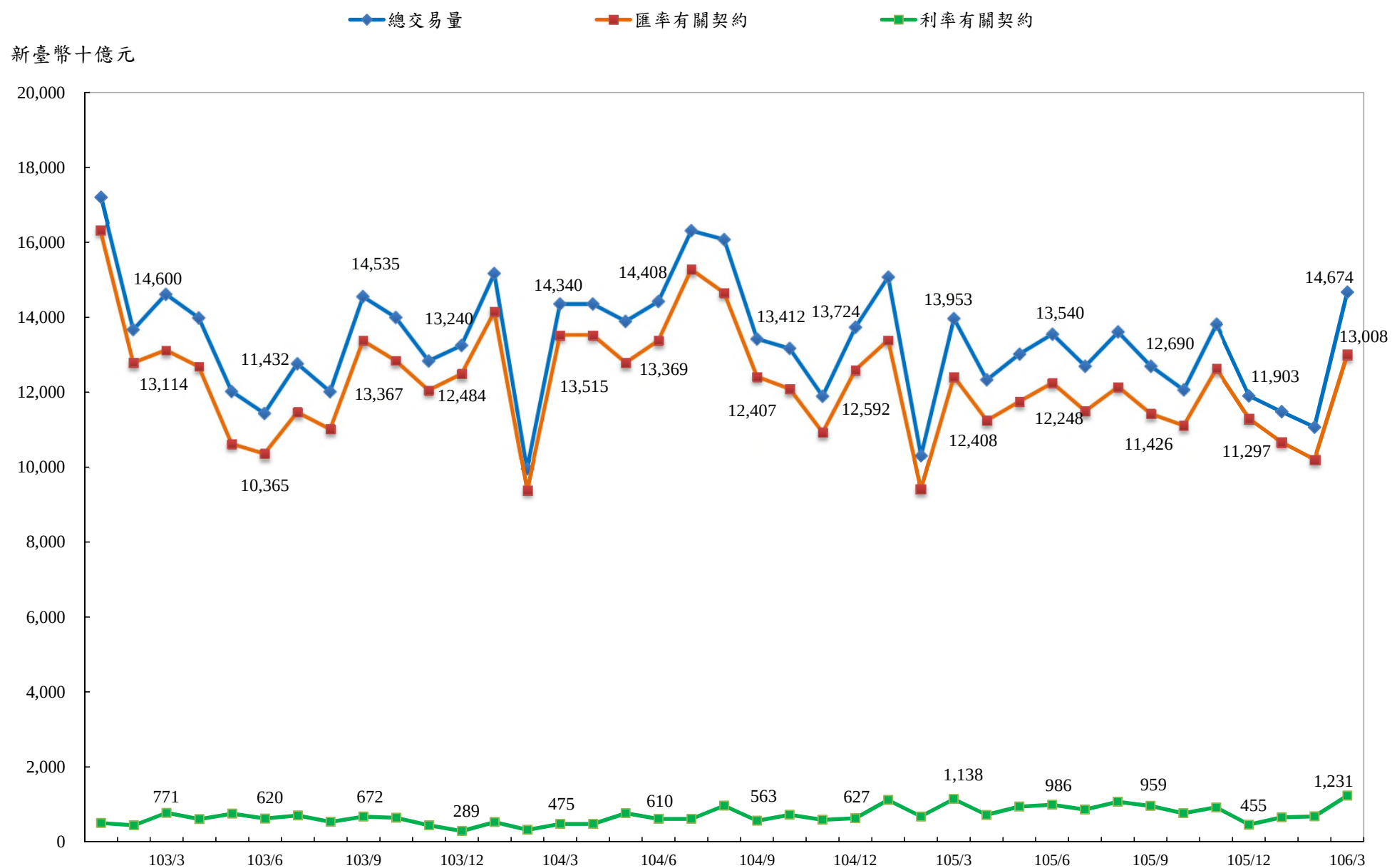
附表2 銀行衍生性金融商品交易量比較表

單位：新臺幣百萬元；%

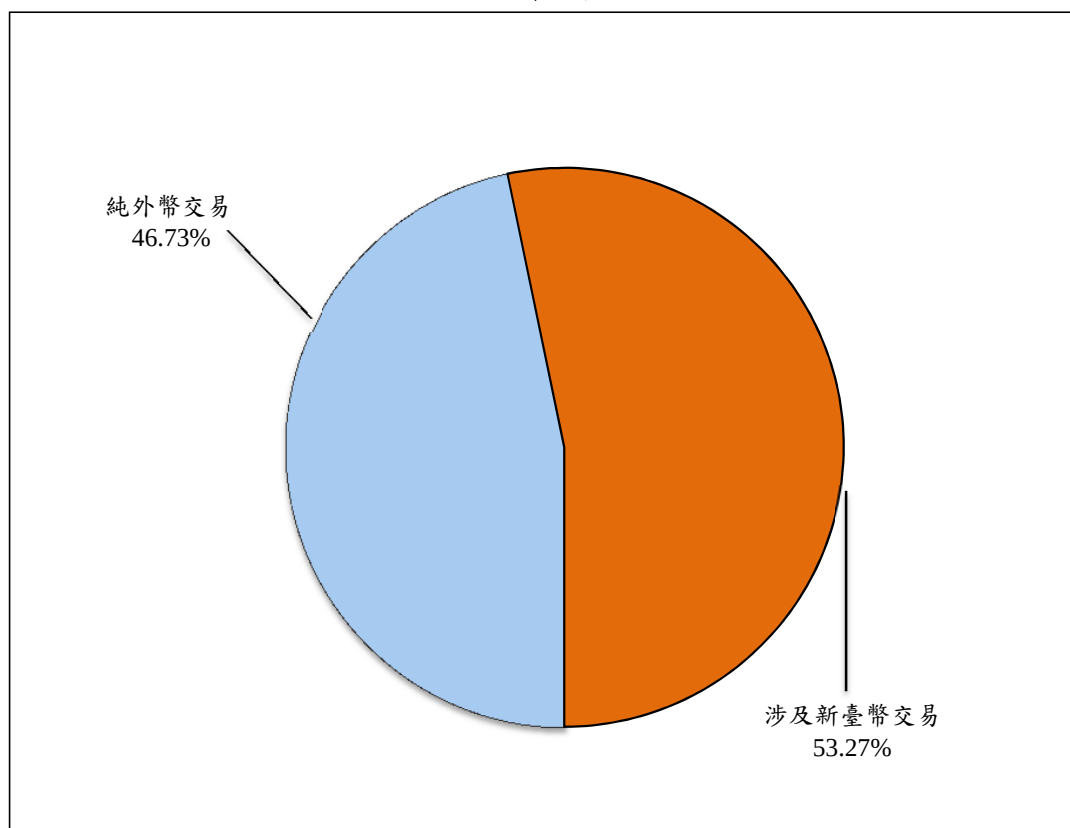
商 品 種 類	106年3月		106年2月		比較增減	
	合計	比重	合計	比重	差 額	變動率
一、利率有關契約(Interest Rate Contracts)	1,231,026	8.39	677,499	6.12	553,527	81.70
(一)店頭市場(OTC)	523,266	3.57	351,128	3.17	172,138	49.02
1.遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-	-	-
2.換利(IRS)	467,567	3.19	320,408	2.89	147,159	45.93
3.買入選擇權(Bought Options)	650	-	1,750	0.02	-1,100	-62.86
4.賣出選擇權(Sold Options)	55,049	0.38	28,970	0.26	26,079	90.02
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	707,760	4.82	326,371	2.95	381,389	116.86
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	300,985	2.05	162,260	1.47	138,725	85.50
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	406,540	2.77	164,071	1.48	242,469	147.78
3.買入選擇權(Bought Options)	152	-	-	-	152	-
4.賣出選擇權(Sold Options)	83	-	40	-	43	107.50
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	13,008,025	88.65	10,206,220	92.21	2,801,805	27.45
(一)店頭市場(OTC)	12,950,037	88.25	10,113,867	91.38	2,836,170	28.04
1.遠期契約(Outright Forwards)	1,437,117	9.79	1,034,338	9.35	402,779	38.94
2.換匯(Fx Swaps)	10,506,889	71.60	8,346,797	75.41	2,160,092	25.88
3.換匯換利(Currency Swaps)	192,340	1.31	99,663	0.90	92,677	92.99
4.買入選擇權(Bought Options)	404,912	2.76	325,140	2.94	79,772	24.53
5.賣出選擇權(Sold Options)	408,779	2.79	307,929	2.78	100,850	32.75
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	57,988	0.40	92,353	0.83	-34,365	-37.21
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	25,039	0.17	39,252	0.36	-14,213	-36.21
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	24,773	0.17	38,910	0.35	-14,137	-36.33
3.買入選擇權(Bought Options)	4,283	0.03	7,078	0.06	-2,795	-39.49
4.賣出選擇權(Sold Options)	3,893	0.03	7,113	0.06	-3,220	-45.27
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	416,376	2.84	168,578	1.52	247,798	146.99
(一)店頭市場(OTC)	430	-	361	-	69	19.11
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	415,946	2.84	168,217	1.52	247,729	147.27
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	15,288	0.10	13,532	0.12	1,756	12.98
(一)店頭市場(OTC)	11,332	0.08	8,285	0.07	3,047	36.78
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	3,956	0.02	5,247	0.05	-1,291	-24.60
小 計(一至四)	14,670,715	99.98	11,065,829	99.97	3,604,886	32.58
五、信用有關契約(Credit Contracts)	3,419	0.02	2,764	0.03	655	23.70
1.信用違約交換(Credit Default Swap)	3,419	0.02	2,764	0.03	655	23.70
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	14,674,134	100.00	11,068,593	100.00	3,605,541	32.57

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3月銀行衍生性金融商品交易量內容分析
幣別



銀行類別

