

**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 <sup>1</sup>			
	涉及新臺幣交易	純外幣交易	合 計	比 重
<b>一、利率有關契約(Interest Rate Contracts)</b>	<b>223,047</b>	<b>763,236</b>	<b>986,283</b>	<b>7.29</b>
(一)店頭市場(OTC)	223,047	145,242	368,289	2.72
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	617,994	617,994	4.57
<b>二、匯率有關契約<sup>2</sup>(Foreign Exchange Transactions)</b>	<b>5,463,775</b>	<b>6,783,969</b>	<b>12,247,744</b>	<b>90.45</b>
(一)店頭市場(OTC)	5,463,775	6,691,430	12,155,205	89.77
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	92,539	92,539	0.68
<b>三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)</b>	<b>284,119</b>	<b>7,365</b>	<b>291,484</b>	<b>2.15</b>
(一)店頭市場(OTC)	330	721	1,051	0.01
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	283,789	6,644	290,433	2.14
<b>四、商品有關契約(Commodity Contracts)</b>	<b>766</b>	<b>12,218</b>	<b>12,984</b>	<b>0.10</b>
(一)店頭市場(OTC)	-	8,748	8,748	0.07
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	766	3,470	4,236	0.03
<b>小 計(一至四)</b>	<b>5,971,707</b>	<b>7,566,788</b>	<b>13,538,495</b>	<b>99.99</b>
<b>五、信用有關契約(Credit Contracts)</b>	<b>-</b>	<b>1,884</b>	<b>1,884</b>	<b>0.01</b>
<b>六、其他有關契約(Other Contracts)</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>
<b>總 計</b>	<b>5,971,707</b>	<b>7,568,672</b>	<b>13,540,379</b>	<b>100.00</b>

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6月	金 額	5,971,707	7,568,672	13,540,379
	比 重	44.10	55.90	100.00
105年5月	金 額	R 5,942,888	7,069,237	R 13,012,125
	比 重	45.67	54.33	100.00
比較增減	差 額	28,819	499,435	528,254
	變動率	0.48	7.06	4.06

註：R為修正後數字。

附表2 銀行衍生性金融商品交易量比較表

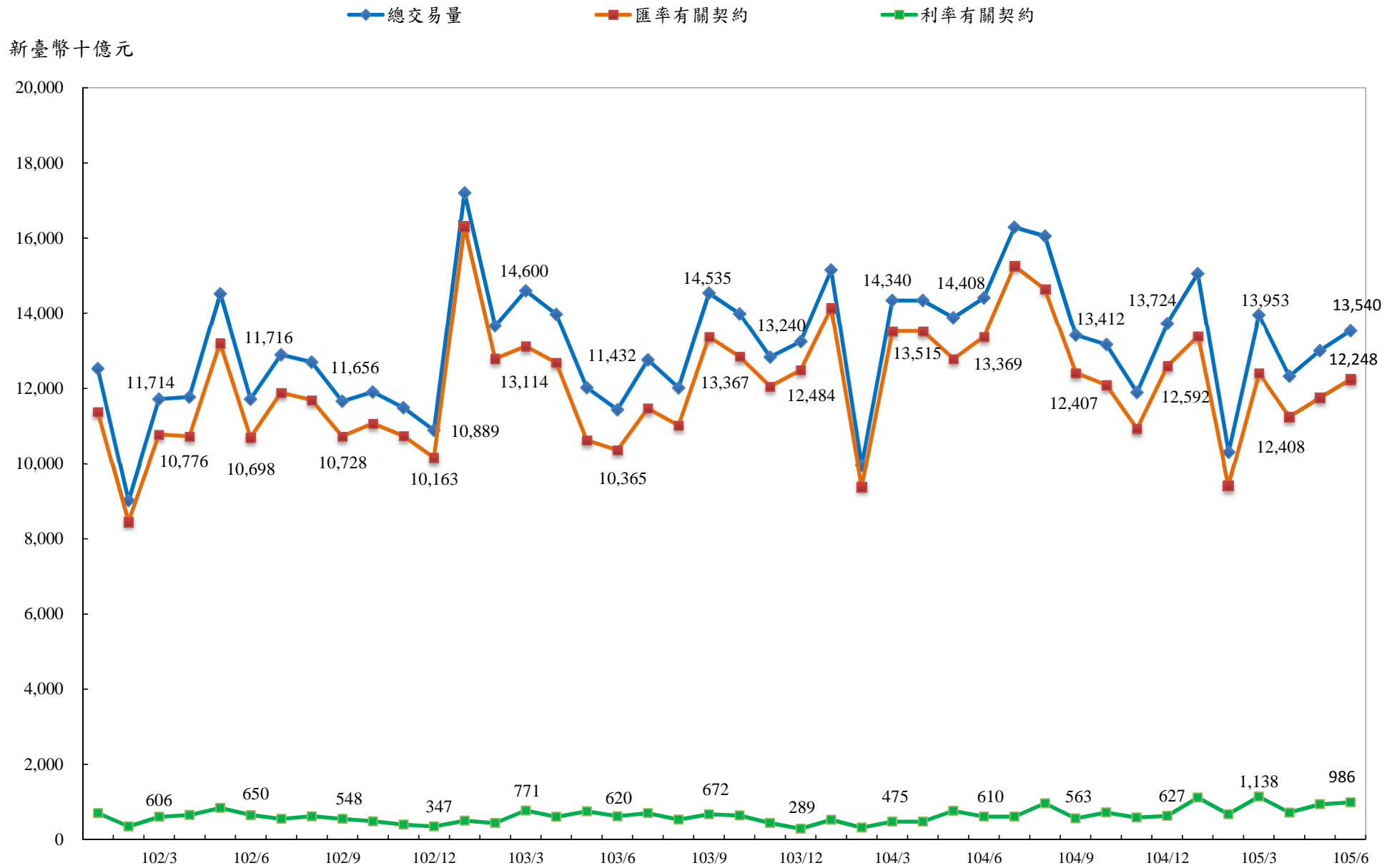
單位：新臺幣百萬元；%

商 品 種 類	105年6月		105年5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>	986,283	7.29	938,855	7.21	47,428	5.05
(一)店頭市場(OTC)	368,289	2.72	481,687	3.70	-113,398	-23.54
1. 遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-	-	-
2. 換利(IRS)	331,607	2.45	465,017	3.57	-133,410	-28.69
3. 買入選擇權(Bought Options)	3,467	0.03	4,867	0.04	-1,400	-28.77
4. 賣出選擇權(Sold Options)	33,215	0.24	11,803	0.09	21,412	181.41
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	617,994	4.57	457,168	3.51	160,826	35.18
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	289,178	2.14	216,870	1.66	72,308	33.34
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	326,391	2.41	240,298	1.85	86,093	35.83
3. 買入選擇權(Bought Options)	1,221	0.01	-	-	1,221	-
4. 賣出選擇權(Sold Options)	1,204	0.01	-	-	1,204	-
<b>二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)</b>	12,247,744	90.45	R 11,750,754	90.31	496,990	4.23
(一)店頭市場(OTC)	12,155,205	89.77	R 11,624,392	89.34	530,813	4.57
1. 遠期契約(Outright Forwards)	1,205,761	8.90	1,265,362	9.72	-59,601	-4.71
2. 換匯(Fx Swaps)	9,850,029	72.75	9,280,347	71.32	569,682	6.14
3. 換匯換利(Currency Swaps)	205,954	1.52	R 116,947	0.90	89,007	76.11
4. 買入選擇權(Bought Options)	450,623	3.33	484,654	3.73	-34,031	-7.02
5. 賣出選擇權(Sold Options)	442,838	3.27	477,082	3.67	-34,244	-7.18
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	92,539	0.68	126,362	0.97	-33,823	-26.77
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	45,491	0.33	63,337	0.49	-17,846	-28.18
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	45,170	0.33	63,025	0.48	-17,855	-28.33
3. 買入選擇權(Bought Options)	982	0.01	-	-	982	-
4. 賣出選擇權(Sold Options)	896	0.01	-	-	896	-
<b>三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)</b>	291,484	2.15	305,624	2.35	-14,140	-4.63
(一)店頭市場(OTC)	1,051	0.01	608	-	443	72.86
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	290,433	2.14	305,016	2.35	-14,583	-4.78
<b>四、商品有關契約(Commodity Contracts)</b>	12,984	0.10	15,031	0.12	-2,047	-13.62
(一)店頭市場(OTC)	8,748	0.07	8,025	0.06	723	9.01
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	4,236	0.03	7,006	0.06	-2,770	-39.54
<b>小 計(一至四)</b>	13,538,495	99.99	R 13,010,264	99.99	528,231	4.06
<b>五、信用有關契約(Credit Contracts)</b>	1,884	0.01	1,861	0.01	23	1.24
1. 信用違約交換(Credit Default Swap)	1,884	0.01	1,861	0.01	23	1.24
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)	-	-	-	-	-	-
<b>總 計<sup>註</sup></b>	13,540,379	100.00	R 13,012,125	100.00	528,254	4.06

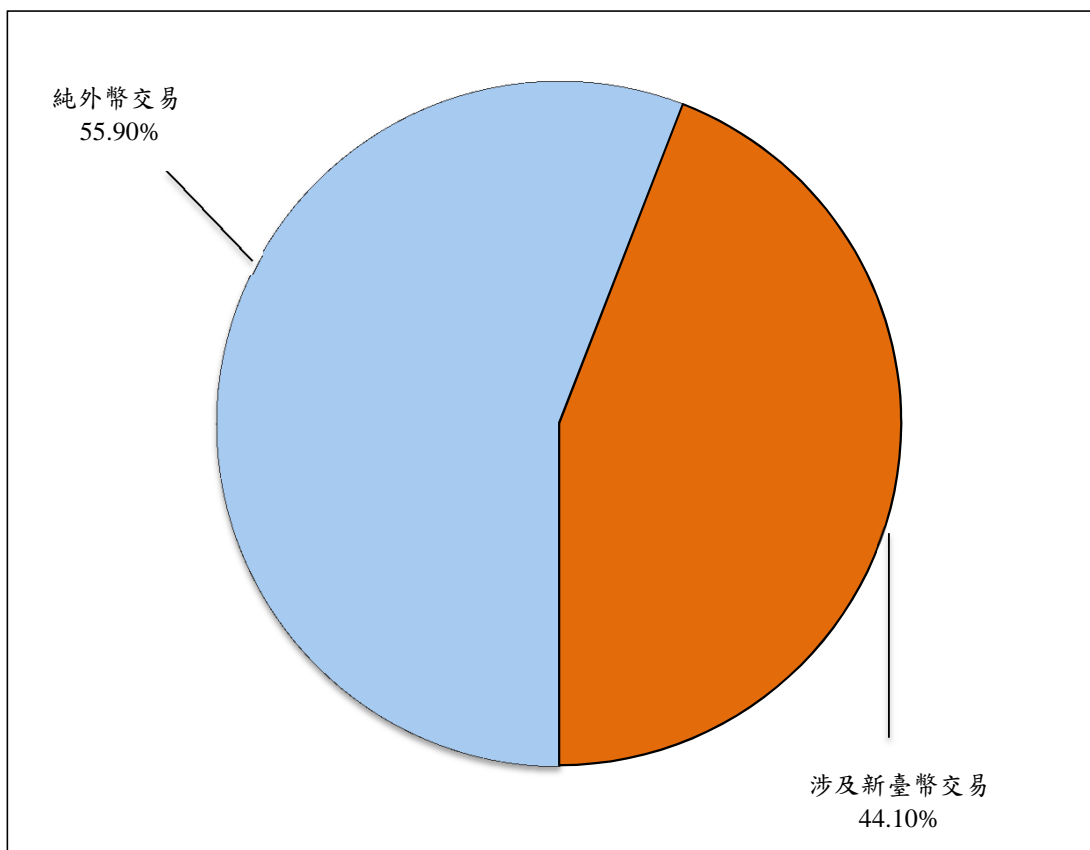
註：1. 包括國內總分支機構及國際金融業務分行資料，不含海外分行及子行；本表已剔除銀行間交易重複計算部分。

2. R為修正後數字。

# 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6月銀行衍生性金融商品交易量內容分析  
幣別



銀行類別

