

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10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)	227, 079	537, 264	764, 343	6. 34
（一）店頭市場(OTC)	227, 079	122, 260	349, 339	2. 90
（二）交易所(Exchange-traded Contracts)	-	415, 004	415, 004	3. 44
二、匯率有關契約²(Foreign Exchange Transactions)	5, 650, 914	5, 458, 965	11, 109, 879	92. 13
（一）店頭市場(OTC)	5, 650, 914	5, 354, 035	11, 004, 949	91. 26
（二）交易所(Exchange-traded Contracts)	-	104, 930	104, 930	0. 87
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	160, 275	13, 368	173, 643	1. 44
（一）店頭市場(OTC)	45	413	458	-
（二）交易所(Exchange-traded Contracts)	160, 230	12, 955	173, 185	1. 44
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	852	9, 610	10, 462	0. 09
（一）店頭市場(OTC)	-	7, 047	7, 047	0. 06
（二）交易所(Exchange-traded Contracts)	852	2, 563	3, 415	0. 03
小 計(一至四)	6, 039, 120	6, 019, 207	12, 058, 327	100. 00
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	365	365	-
六、其他有關契約(Other Contracts)	-	-	-	-
總 計	6, 039, 120	6, 019, 572	12, 058, 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10月	金 額	6, 039, 120	6, 019, 572	12, 058, 692
	比 重	50. 08	49. 92	100. 00
105年9月	金 額	6, 094, 312	6, 595, 417	12, 689, 729
	比 重	48. 03	51. 97	100. 00
比較增減	差 額	-55, 192	-575, 845	-631, 037
	變動率	-0. 91	-8. 73	-4. 97

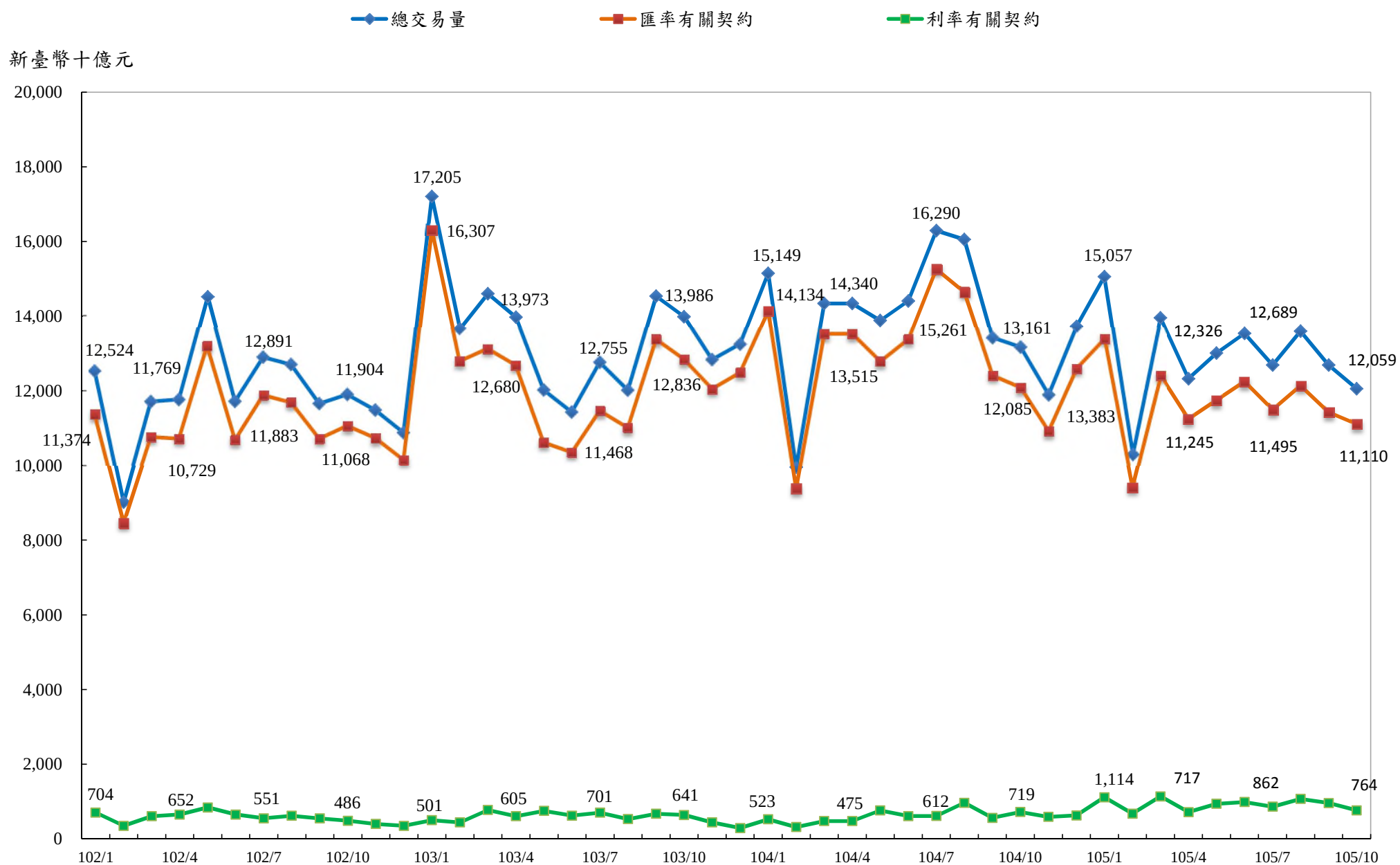
附表2 銀行衍生性金融商品交易量比較表

單位：新臺幣百萬元；%

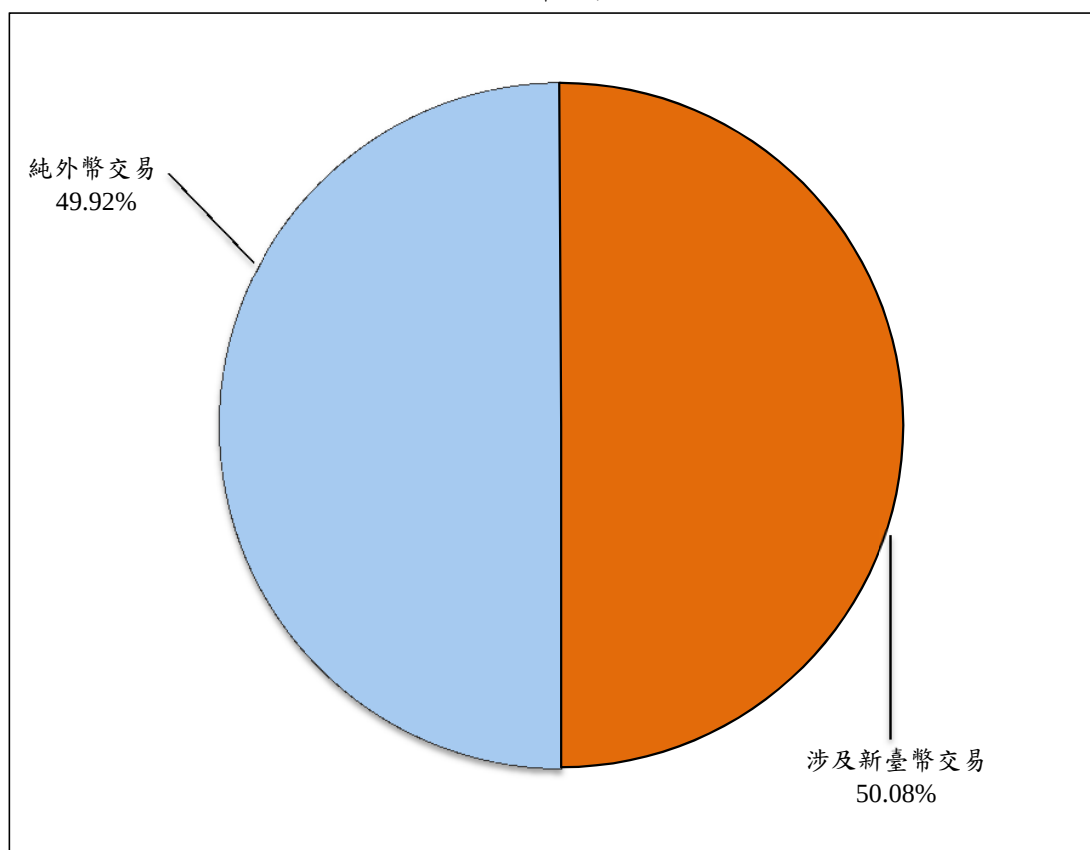
商 品 種 類	105年10月		105年9月		比較增減	
	合計	比重	合計	比重	差 額	變動率
一、利率有關契約(Interest Rate Contracts)	764,343	6.34	959,038	7.56	-194,695	-20.30
(一)店頭市場(OTC)	349,339	2.90	307,472	2.42	41,867	13.62
1. 遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-	-	-
2. 換利(IRS)	334,229	2.77	296,493	2.34	37,736	12.73
3. 買入選擇權(Bought Options)	280	-	1,798	0.01	-1,518	-84.43
4. 賣出選擇權(Sold Options)	14,830	0.13	9,181	0.07	5,649	61.53
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	415,004	3.44	651,566	5.14	-236,562	-36.31
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	225,536	1.87	309,087	2.44	-83,551	-27.03
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	189,190	1.57	342,479	2.70	-153,289	-44.76
3. 買入選擇權(Bought Options)	278	-	-	-	278	-
4. 賣出選擇權(Sold Options)	-	-	-	-	-	-
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	11,109,879	92.13	11,426,438	90.04	-316,559	-2.77
(一)店頭市場(OTC)	11,004,949	91.26	11,364,585	89.55	-359,636	-3.16
1. 遠期契約(Outright Forwards)	1,303,007	10.81	1,070,871	8.44	232,136	21.68
2. 換匯(Fx Swaps)	8,768,514	72.71	9,291,256	73.22	-522,742	-5.63
3. 換匯換利(Currency Swaps)	110,062	0.91	259,602	2.04	-149,540	-57.60
4. 買入選擇權(Bought Options)	410,348	3.40	381,538	3.00	28,810	7.55
5. 賣出選擇權(Sold Options)	413,018	3.43	361,318	2.85	51,700	14.31
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	104,930	0.87	61,853	0.49	43,077	69.64
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	49,686	0.41	27,758	0.22	21,928	79.00
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	48,908	0.40	28,939	0.23	19,969	69.00
3. 買入選擇權(Bought Options)	3,186	0.03	2,960	0.02	226	7.64
4. 賣出選擇權(Sold Options)	3,150	0.03	2,196	0.02	954	43.44
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	173,643	1.44	289,059	2.28	-115,416	-39.93
(一)店頭市場(OTC)	458	-	644	0.01	-186	-28.88
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	173,185	1.44	288,415	2.27	-115,230	-39.95
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	10,462	0.09	14,618	0.12	-4,156	-28.43
(一)店頭市場(OTC)	7,047	0.06	10,744	0.09	-3,697	-34.41
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	3,415	0.03	3,874	0.03	-459	-11.85
小 計(一至四)	12,058,327	100.00	12,689,153	100.00	-630,826	-4.97
五、信用有關契約(Credit Contracts)	365	-	576	-	-211	-36.63
1. 信用違約交換(Credit Default Swap)	365	-	576	-	-211	-36.63
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	12,058,692	100.00	12,689,729	100.00	-631,037	-4.97

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10月銀行衍生性金融商品交易量內容分析
幣別



銀行類別

