

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11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)	284,824	633,086	917,910	6.65
(一)店頭市場(OTC)	284,824	198,976	483,800	3.50
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	434,110	434,110	3.15
二、匯率有關契約²(Foreign Exchange Transactions)	6,569,518	6,057,502	12,627,020	91.47
(一)店頭市場(OTC)	6,569,518	5,987,614	12,557,132	90.96
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	69,888	69,888	0.51
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	241,312	7,143	248,455	1.80
(一)店頭市場(OTC)	91	104	195	-
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	241,221	7,039	248,260	1.80
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	692	9,487	10,179	0.07
(一)店頭市場(OTC)	-	7,970	7,970	0.06
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	692	1,517	2,209	0.01
小 計(一至四)	7,096,346	6,707,218	13,803,564	99.99
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	1,116	1,116	0.01
六、其他有關契約(Other Contracts)	-	-	-	-
總 計	7,096,346	6,708,334	13,804,680	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11月	金 額	7,096,346	6,708,334	13,804,680
	比 重	51.41	48.59	100.00
105年10月	金 額	6,039,120	6,019,572	12,058,692
	比 重	50.08	49.92	100.00
比較增減	差 額	1,057,226	688,762	1,745,988
	變動率	17.51	11.44	14.48

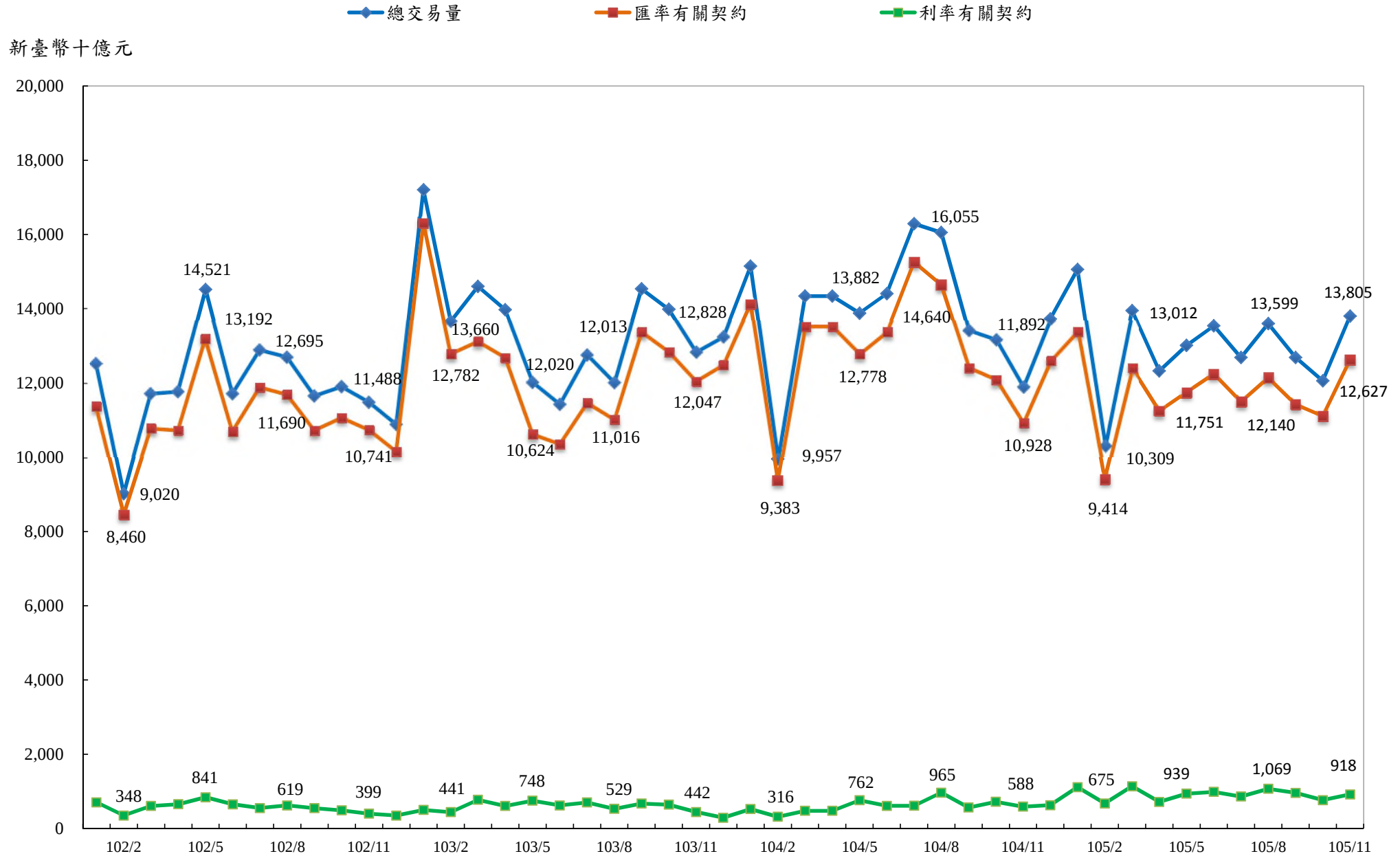
附表2 銀行衍生性金融商品交易量比較表

單位：新臺幣百萬元；%

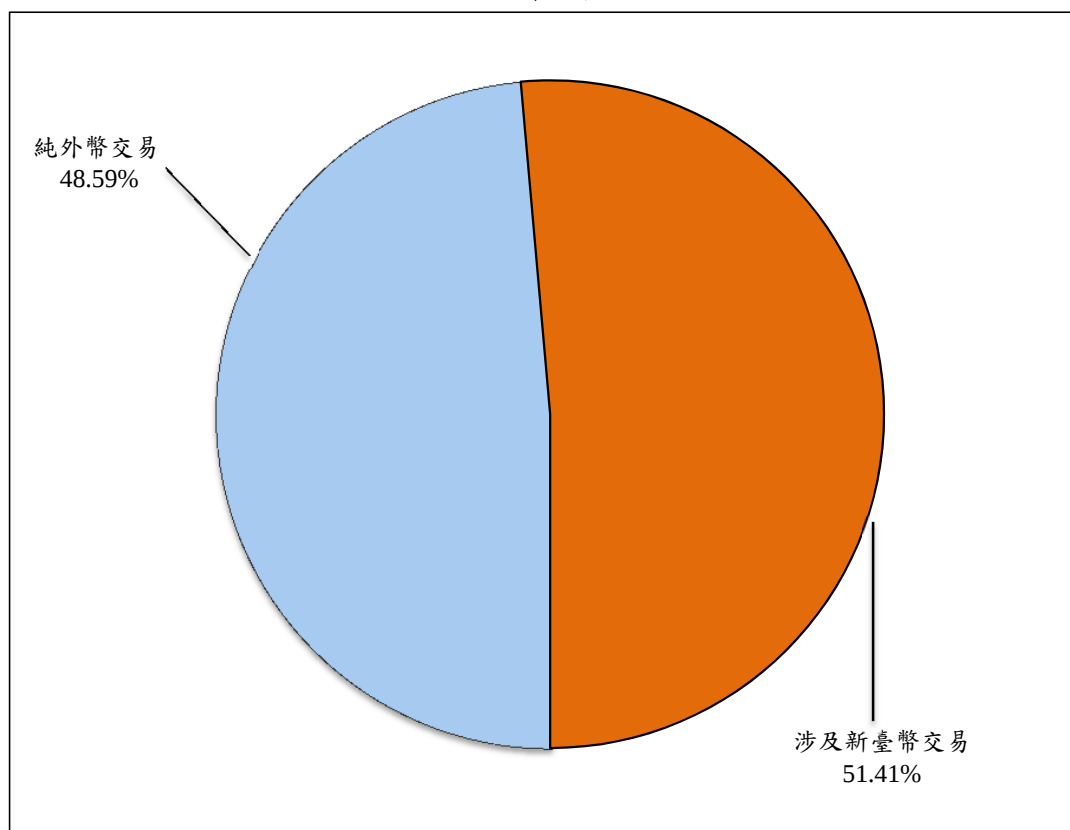
商 品 種 類	105年11月		105年10月		比較增減	
	合計	比重	合計	比重	差 額	變動率
一、利率有關契約(Interest Rate Contracts)	917,910	6.65	764,343	6.34	153,567	20.09
(一)店頭市場(OTC)	483,800	3.50	349,339	2.90	134,461	38.49
1. 遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-	-	-
2. 換利(IRS)	430,141	3.11	334,229	2.77	95,912	28.70
3. 買入選擇權(Bought Options)	24,935	0.18	280	0.00	24,655	8,805.36
4. 賣出選擇權(Sold Options)	28,724	0.21	14,830	0.13	13,894	93.69
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	434,110	3.15	415,004	3.44	19,106	4.60
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	216,772	1.57	225,536	1.87	-8,764	-3.89
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	210,051	1.52	189,190	1.57	20,861	11.03
3. 買入選擇權(Bought Options)	5,055	0.04	278	-	4,777	1,718.35
4. 賣出選擇權(Sold Options)	2,232	0.02	-	-	2,232	-
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	12,627,020	91.47	11,109,879	92.13	1,517,141	13.66
(一)店頭市場(OTC)	12,557,132	90.96	11,004,949	91.26	1,552,183	14.10
1. 遠期契約(Outright Forwards)	1,573,591	11.40	1,303,007	10.81	270,584	20.77
2. 換匯(Fx Swaps)	9,926,747	71.91	8,768,514	72.71	1,158,233	13.21
3. 換匯換利(Currency Swaps)	150,043	1.08	110,062	0.91	39,981	36.33
4. 買入選擇權(Bought Options)	460,687	3.34	410,348	3.40	50,339	12.27
5. 賣出選擇權(Sold Options)	446,064	3.23	413,018	3.43	33,046	8.00
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	69,888	0.51	104,930	0.87	-35,042	-33.40
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	31,470	0.23	49,686	0.41	-18,216	-36.66
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	31,315	0.23	48,908	0.40	-17,593	-35.97
3. 買入選擇權(Bought Options)	3,600	0.03	3,186	0.03	414	12.99
4. 賣出選擇權(Sold Options)	3,503	0.02	3,150	0.03	353	11.21
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	248,455	1.80	173,643	1.44	74,812	43.08
(一)店頭市場(OTC)	195	-	458	-	-263	-57.42
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	248,260	1.80	173,185	1.44	75,075	43.35
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	10,179	0.07	10,462	0.09	-283	-2.71
(一)店頭市場(OTC)	7,970	0.06	7,047	0.06	923	13.10
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	2,209	0.01	3,415	0.03	-1,206	-35.31
小 計(一至四)	13,803,564	99.99	12,058,327	100.00	1,745,237	14.47
五、信用有關契約(Credit Contracts)	1,116	0.01	365	-	751	205.75
1. 信用違約交換(Credit Default Swap)	1,116	0.01	365	-	751	205.75
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	13,804,680	100.00	12,058,692	100.00	1,745,988	14.48

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2 105年11月銀行衍生性金融商品交易量內容分析
幣別



銀行類別

