

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9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)	244, 865	714, 173	959, 038	7. 56
(一)店頭市場(OTC)	244, 865	62, 607	307, 472	2. 42
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	651, 566	651, 566	5. 14
二、匯率有關契約²(Foreign Exchange Transactions)	5, 572, 906	5, 853, 532	11, 426, 438	90. 04
(一)店頭市場(OTC)	5, 572, 906	5, 791, 679	11, 364, 585	89. 55
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	61, 853	61, 853	0. 49
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	275, 693	13, 366	289, 059	2. 28
(一)店頭市場(OTC)	65	579	644	0. 01
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	275, 628	12, 787	288, 415	2. 27
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	848	13, 770	14, 618	0. 12
(一)店頭市場(OTC)	-	10, 744	10, 744	0. 09
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	848	3, 026	3, 874	0. 03
小 計(一至四)	6, 094, 312	6, 594, 841	12, 689, 153	100. 00
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	576	576	-
六、其他有關契約(Other Contracts)	-	-	-	-
總 計	6, 094, 312	6, 595, 417	12, 689, 729	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9月	金 額	6, 094, 312	6, 595, 417	12, 689, 729
	比 重	48. 03	51. 97	100. 00
105年8月	金 額	5, 959, 030	7, 640, 297	13, 599, 327
	比 重	43. 82	56. 18	100. 00
比較增減	差 額	135, 282	-1, 044, 880	-909, 598
	變動率	2. 27	-13. 68	-6. 69

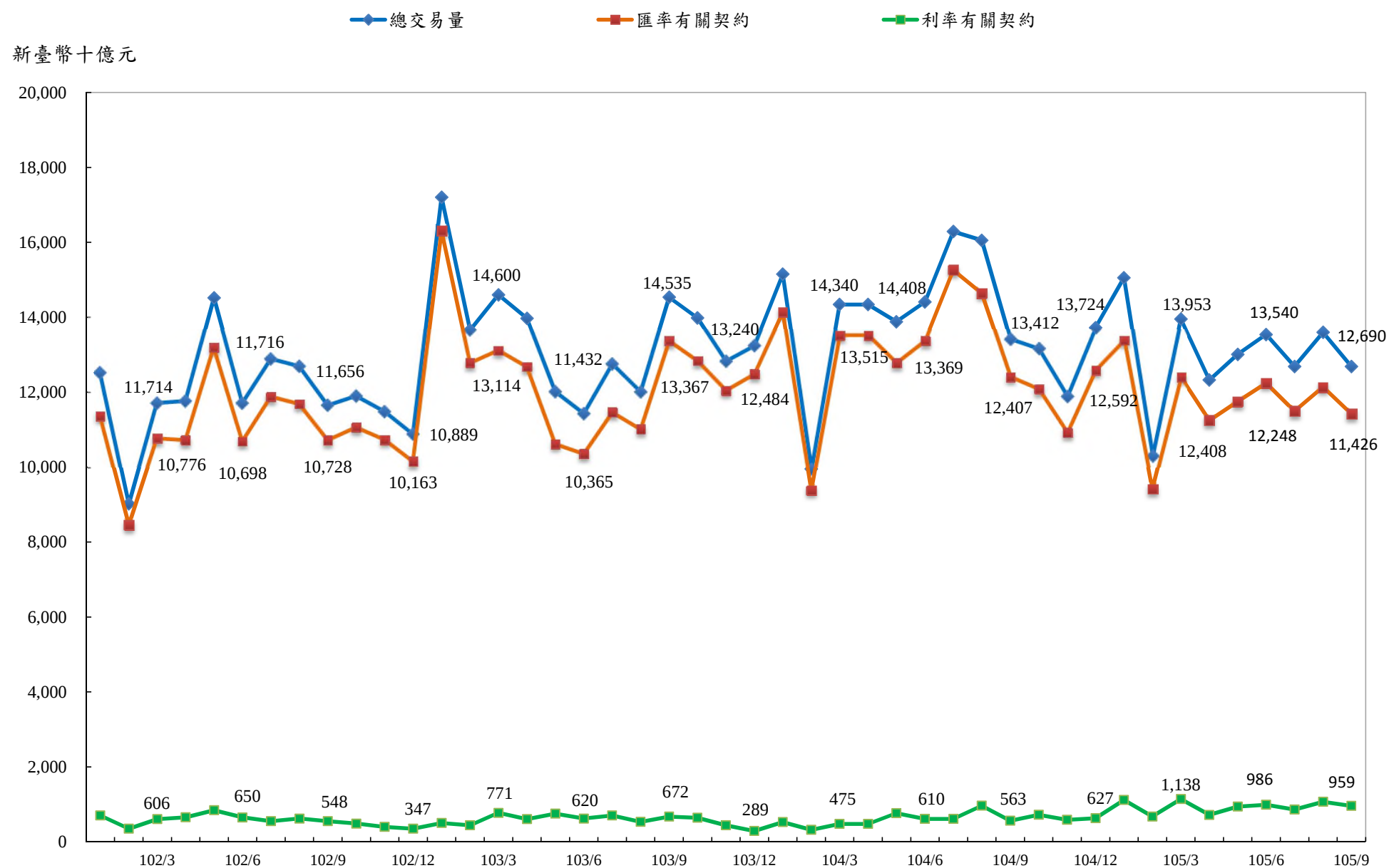
附表2 銀行衍生性金融商品交易量比較表

單位：新臺幣百萬元；%

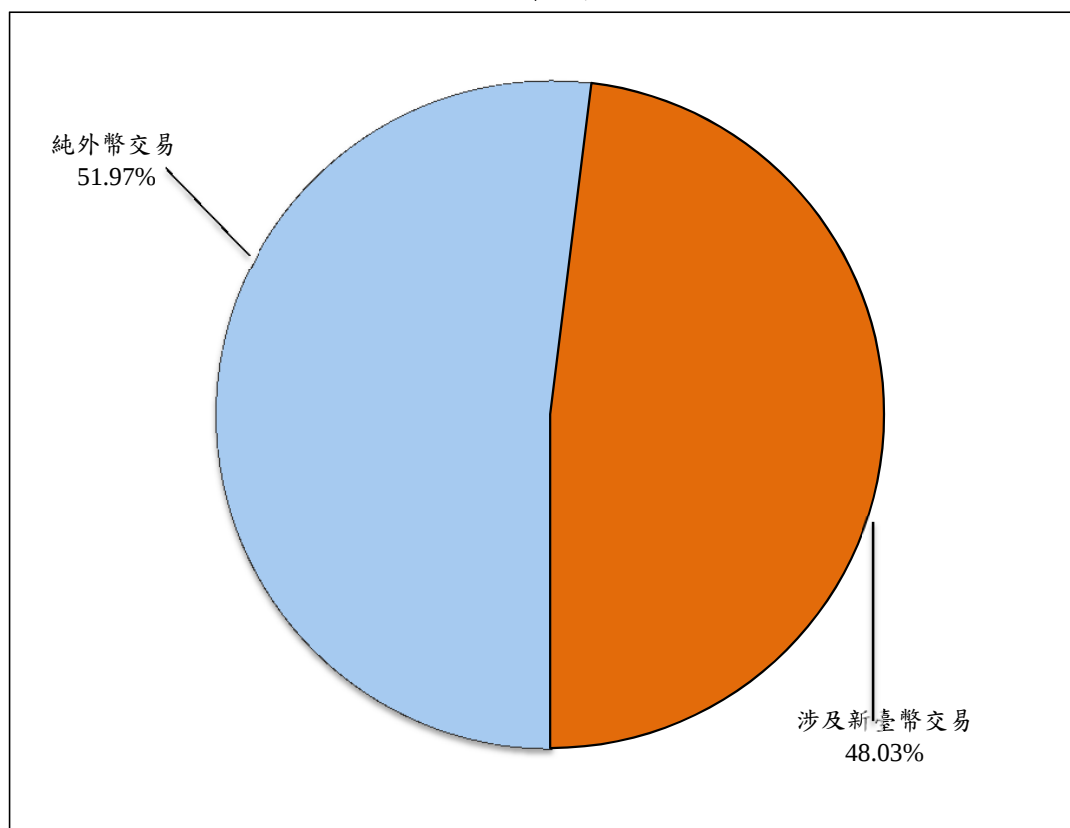
商 品 種 類	105年9月		105年8月		比較增減	
	合計	比重	合計	比重	差 額	變動率
一、利率有關契約(Interest Rate Contracts)	959,038	7.56	1,068,943	7.86	-109,905	-10.28
(一)店頭市場(OTC)	307,472	2.42	339,622	2.50	-32,150	-9.47
1. 遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-	-	-
2. 換利(IRS)	296,493	2.34	326,373	2.40	-29,880	-9.16
3. 買入選擇權(Bought Options)	1,798	0.01	2,714	0.02	-916	-33.75
4. 賣出選擇權(Sold Options)	9,181	0.07	10,535	0.08	-1,354	-12.85
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	651,566	5.14	729,321	5.36	-77,755	-10.66
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	309,087	2.44	335,750	2.47	-26,663	-7.94
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	342,479	2.70	393,571	2.89	-51,092	-12.98
3. 買入選擇權(Bought Options)	-	-	-	-	-	-
4. 賣出選擇權(Sold Options)	-	-	-	-	-	-
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	11,426,438	90.04	12,139,538	89.27	-713,100	-5.87
(一)店頭市場(OTC)	11,364,585	89.55	11,990,667	88.17	-626,082	-5.22
1. 遠期契約(Outright Forwards)	1,070,871	8.44	1,261,961	9.28	-191,090	-15.14
2. 換匯(Fx Swaps)	9,291,256	73.22	9,794,276	72.02	-503,020	-5.14
3. 換匯換利(Currency Swaps)	259,602	2.04	54,792	0.40	204,810	373.80
4. 買入選擇權(Bought Options)	381,538	3.00	443,980	3.27	-62,442	-14.06
5. 賣出選擇權(Sold Options)	361,318	2.85	435,658	3.20	-74,340	-17.06
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	61,853	0.49	148,871	1.10	-87,018	-58.45
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	27,758	0.22	39,561	0.29	-11,803	-29.83
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	28,939	0.23	38,243	0.28	-9,304	-24.33
3. 買入選擇權(Bought Options)	2,960	0.02	36,335	0.27	-33,375	-91.85
4. 賣出選擇權(Sold Options)	2,196	0.02	34,732	0.26	-32,536	-93.68
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	289,059	2.28	375,931	2.76	-86,872	-23.11
(一)店頭市場(OTC)	644	0.01	650	-	-6	-0.92
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	288,415	2.27	375,281	2.76	-86,866	-23.15
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	14,618	0.12	13,540	0.10	1,078	7.96
(一)店頭市場(OTC)	10,744	0.09	9,936	0.07	808	8.13
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	3,874	0.03	3,604	0.03	270	7.49
小 計(一至四)	12,689,153	100.00	13,597,952	99.99	-908,799	-6.68
五、信用有關契約(Credit Contracts)	576	-	1,375	0.01	-799	-58.11
1. 信用違約交換(Credit Default Swap)	576	-	1,375	0.01	-799	-58.11
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	12,689,729	100.00	13,599,327	100.00	-909,598	-6.69

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9月銀行衍生性金融商品交易量內容分析
幣別



銀行類別

