

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8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)	83,467	1,205,328	1,288,795	9.87
（一）店頭市場(OTC)	83,318	95,113	178,431	1.37
（二）交易所(Exchange-traded Contracts)	149	1,110,215	1,110,364	8.50
二、匯率有關契約²(Foreign Exchange Transactions)	5,754,057	5,590,302	11,344,359	86.91
（一）店頭市場(OTC)	5,754,057	5,520,477	11,274,534	86.38
（二）交易所(Exchange-traded Contracts)	-	69,825	69,825	0.53
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	394,444	5,971	400,415	3.07
（一）店頭市場(OTC)	-	478	478	-
（二）交易所(Exchange-traded Contracts)	394,444	5,493	399,937	3.07
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	948	16,786	17,734	0.14
（一）店頭市場(OTC)	-	6,961	6,961	0.06
（二）交易所(Exchange-traded Contracts)	948	9,825	10,773	0.08
小 計(一至四)	6,232,916	6,818,387	13,051,303	99.99
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	1,577	1,577	0.01
六、其他有關契約(Other Contracts)	-	-	-	-
總 計	6,232,916	6,819,964	13,052,880	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8月	金 額	6,232,916	6,819,964	13,052,880
	比 重	47.75	52.25	100.00
106年7月	金 額	6,298,747	5,788,712	12,087,459
	比 重	52.11	47.89	100.00
比較增減	差 額	-65,831	1,031,252	965,421
	變動率	-1.05	17.81	7.99

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；%

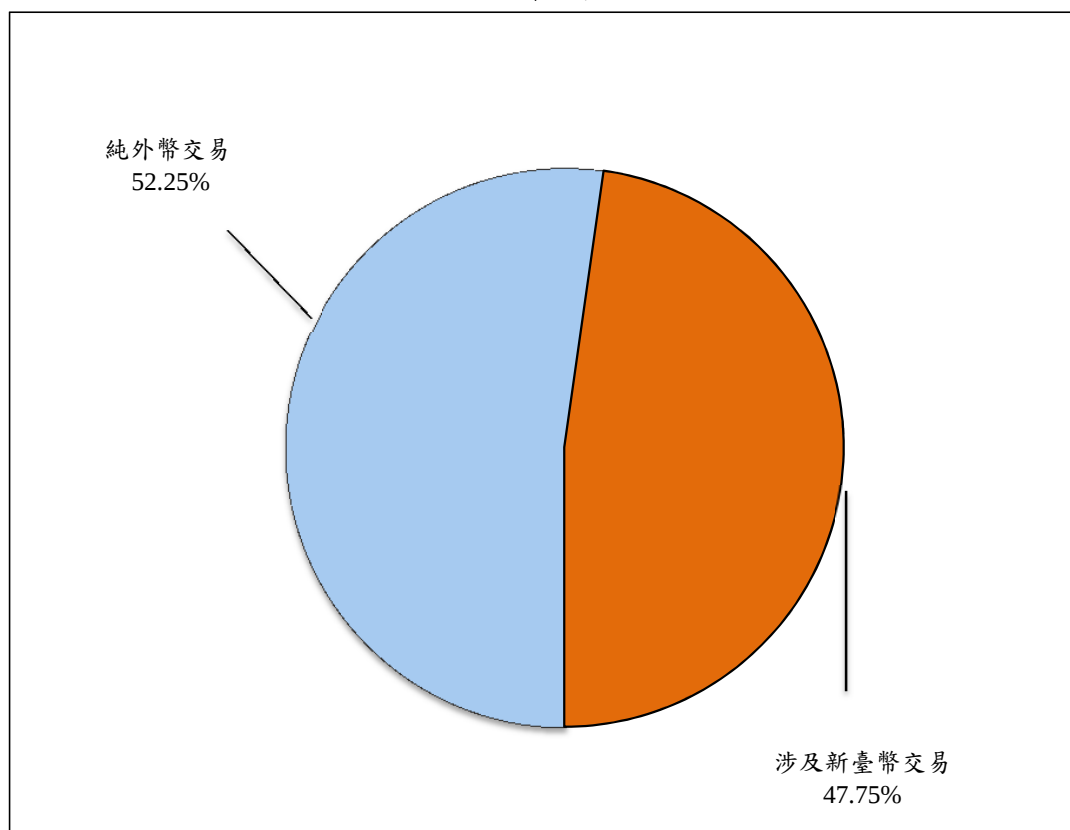
商 品 種 類	106年8月		106年7月		比較增減	
	合計	比重	合計	比重	差 額	變動率
一、利率有關契約(Interest Rate Contracts)	1,288,795	9.87	946,464	7.83	342,331	36.17
(一)店頭市場(OTC)	178,431	1.37	190,123	1.57	-11,692	-6.15
1. 遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-	-	-
2. 換利(IRS)	176,304	1.35	176,283	1.46	21	0.01
3. 買入選擇權(Bought Options)	15	-	-	-	15	-
4. 賣出選擇權(Sold Options)	2,112	0.02	13,840	0.11	-11,728	-84.74
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	1,110,364	8.50	756,341	6.26	354,023	46.81
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	543,140	4.16	359,605	2.98	183,535	51.04
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	566,954	4.34	396,658	3.28	170,296	42.93
3. 買入選擇權(Bought Options)	121	-	-	-	121	-
4. 賣出選擇權(Sold Options)	149	-	78	-	71	91.03
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	11,344,359	86.91	10,745,755	88.90	598,604	5.57
(一)店頭市場(OTC)	11,274,534	86.38	10,675,170	88.32	599,364	5.61
1. 遠期契約(Outright Forwards)	1,057,426	8.10	1,015,815	8.41	41,611	4.10
2. 換匯(Fx Swaps)	9,430,852	72.25	8,957,957	74.11	472,895	5.28
3. 換匯換利(Currency Swaps)	114,377	0.88	155,808	1.29	-41,431	-26.59
4. 買入選擇權(Bought Options)	343,009	2.63	280,598	2.32	62,411	22.24
5. 賣出選擇權(Sold Options)	328,870	2.52	264,992	2.19	63,878	24.11
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	69,825	0.53	70,585	0.58	-760	-1.08
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	28,856	0.22	28,427	0.24	429	1.51
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	27,511	0.21	28,119	0.23	-608	-2.16
3. 買入選擇權(Bought Options)	7,512	0.06	7,788	0.06	-276	-3.54
4. 賣出選擇權(Sold Options)	5,946	0.04	6,251	0.05	-305	-4.88
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	400,415	3.07	385,256	3.19	15,159	3.93
(一)店頭市場(OTC)	478	-	54	-	424	785.19
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	399,937	3.07	385,202	3.19	14,735	3.83
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	17,734	0.14	9,682	0.08	8,052	83.16
(一)店頭市場(OTC)	6,961	0.06	6,313	0.05	648	10.26
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	10,773	0.08	3,369	0.03	7,404	219.77
小 計(一至四)	13,051,303	99.99	12,087,157	100.00	964,146	7.98
五、信用有關契約(Credit Contracts)	1,577	0.01	302	-	1,275	422.19
1. 信用違約交換(Credit Default Swap)	1,577	0.01	302	-	1,275	422.19
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	13,052,880	100.00	12,087,459	100.00	965,421	7.99

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8月銀行衍生性金融商品交易量內容分析
幣別



銀行類別

