

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12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)	174,408	606,397	780,805	6.83
（一）店頭市場(OTC)	174,242	154,144	328,386	2.87
（二）交易所(Exchange-traded Contracts)	166	452,253	452,419	3.96
二、匯率有關契約²(Foreign Exchange Transactions)	5,627,015	4,758,157	10,385,172	90.90
（一）店頭市場(OTC)	5,627,015	4,715,419	10,342,434	90.53
（二）交易所(Exchange-traded Contracts)	-	42,738	42,738	0.37
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	239,612	11,983	251,595	2.20
（一）店頭市場(OTC)	10	199	209	-
（二）交易所(Exchange-traded Contracts)	239,602	11,784	251,386	2.20
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	628	5,775	6,403	0.06
（一）店頭市場(OTC)	-	4,130	4,130	0.04
（二）交易所(Exchange-traded Contracts)	628	1,645	2,273	0.02
小 計(一至四)	6,041,663	5,382,312	11,423,975	99.99
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	1,044	1,044	0.01
六、其他有關契約(Other Contracts)	-	-	-	-
總 計	6,041,663	5,383,356	11,425,019	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12月	金 額	6,041,663	5,383,356	11,425,019
	比 重	52.88	47.12	100.00
106年11月	金 額	6,584,518	5,963,468	12,547,986
	比 重	52.47	47.53	100.00
比較增減	差 額	-542,855	-580,112	-1,122,967
	變動率	-8.24	-9.73	-8.95

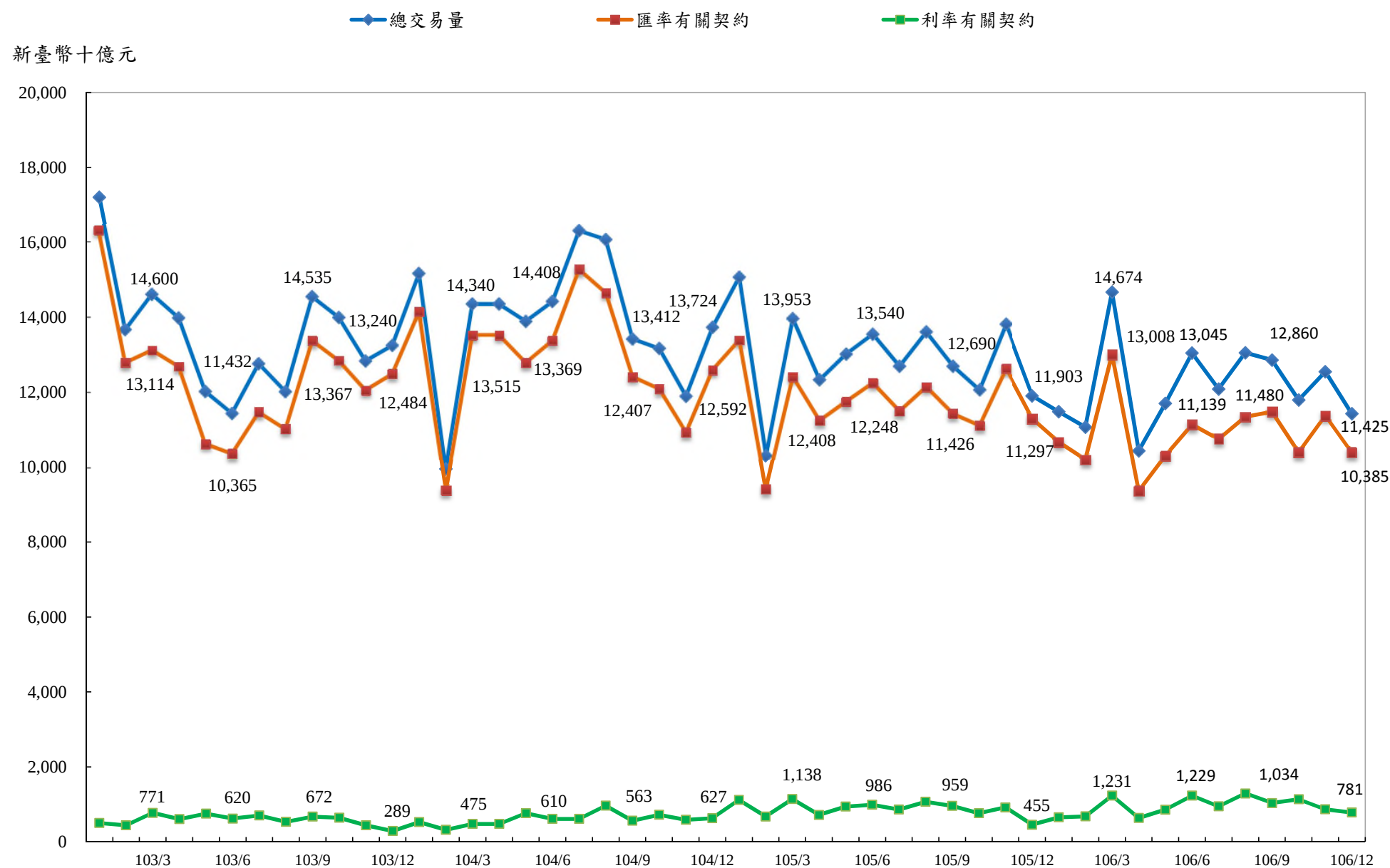
附表2 銀行衍生性金融商品交易量比較表

單位：新臺幣百萬元；%

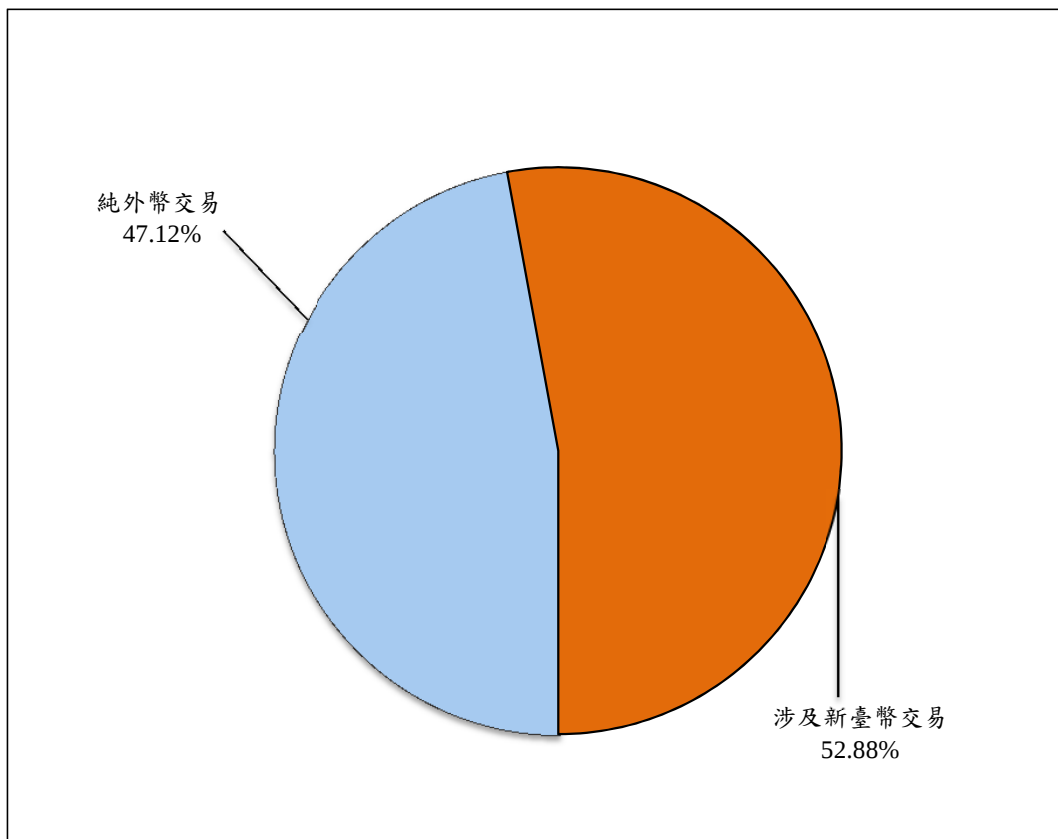
商 品 種 類	106年12月		106年11月		比較增減	
	合計	比重	合計	比重	差 額	變動率
一、利率有關契約(Interest Rate Contracts)	780,805	6.83	864,305	6.89	-83,500	-9.66
(一)店頭市場(OTC)	328,386	2.87	274,231	2.19	54,155	19.75
1. 遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-	-	-
2. 換利(IRS)	291,563	2.55	234,815	1.87	56,748	24.17
3. 買入選擇權(Bought Options)	299	-	9,157	0.08	-8,858	-96.73
4. 賣出選擇權(Sold Options)	36,524	0.32	30,259	0.24	6,265	20.70
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	452,419	3.96	590,074	4.70	-137,655	-23.33
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	193,907	1.70	292,485	2.33	-98,578	-33.70
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	258,346	2.26	296,581	2.36	-38,235	-12.89
3. 買入選擇權(Bought Options)	-	-	120	-	-120	-100.00
4. 賣出選擇權(Sold Options)	166	-	888	0.01	-722	-81.31
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	10,385,172	90.90	11,372,732	90.63	-987,560	-8.68
(一)店頭市場(OTC)	10,342,434	90.53	11,317,646	90.19	-975,212	-8.62
1. 遠期契約(Outright Forwards)	882,889	7.73	1,167,579	9.30	-284,690	-24.38
2. 換匯(Fx Swaps)	8,940,964	78.26	9,441,895	75.25	-500,931	-5.31
3. 換匯換利(Currency Swaps)	144,746	1.27	92,768	0.74	51,978	56.03
4. 買入選擇權(Bought Options)	196,233	1.72	316,687	2.52	-120,454	-38.04
5. 賣出選擇權(Sold Options)	177,602	1.55	298,717	2.38	-121,115	-40.55
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	42,738	0.37	55,086	0.44	-12,348	-22.42
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	14,608	0.13	21,598	0.17	-6,990	-32.36
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	14,813	0.13	21,210	0.17	-6,397	-30.16
3. 買入選擇權(Bought Options)	7,477	0.06	6,572	0.05	905	13.77
4. 賣出選擇權(Sold Options)	5,840	0.05	5,706	0.05	134	2.35
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	251,595	2.20	300,823	2.40	-49,228	-16.36
(一)店頭市場(OTC)	209	-	287	-	-78	-27.18
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	251,386	2.20	300,536	2.40	-49,150	-16.35
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	6,403	0.06	9,916	0.08	-3,513	-35.43
(一)店頭市場(OTC)	4,130	0.04	4,036	0.03	94	2.33
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	2,273	0.02	5,880	0.05	-3,607	-61.34
小 計(一至四)	11,423,975	99.99	12,547,776	100.00	-1,123,801	-8.96
五、信用有關契約(Credit Contracts)	1,044	0.01	210	-	834	397.14
1. 信用違約交換(Credit Default Swap)	1,044	0.01	210	-	834	397.14
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	11,425,019	100.00	12,547,986	100.00	-1,122,967	-8.95

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12月銀行衍生性金融商品交易量內容分析
幣別



銀行類別

