

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)	165,097	699,208	864,305	6.89
(一)店頭市場(OTC)	164,329	109,902	274,231	2.19
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	768	589,306	590,074	4.70
二、匯率有關契約²(Foreign Exchange Transactions)	6,130,082	5,242,650	11,372,732	90.63
(一)店頭市場(OTC)	6,130,082	5,187,564	11,317,646	90.19
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	55,086	55,086	0.44
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	288,564	12,259	300,823	2.40
(一)店頭市場(OTC)	-	287	287	-
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	288,564	11,972	300,536	2.40
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	775	9,141	9,916	0.08
(一)店頭市場(OTC)	-	4,036	4,036	0.03
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	775	5,105	5,880	0.05
小 計(一至四)	6,584,518	5,963,258	12,547,776	100.00
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	210	210	-
六、其他有關契約(Other Contracts)	-	-	-	-
總 計	6,584,518	5,963,468	12,547,986	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11月	金 額	6,584,518	5,963,468	12,547,986
	比 重	52.47	47.53	100.00
106年10月	金 額	6,105,919	5,688,674	11,794,593
	比 重	51.77	48.23	100.00
比較增減	差 額	478,599	274,794	753,393
	變動率	7.84	4.83	6.39

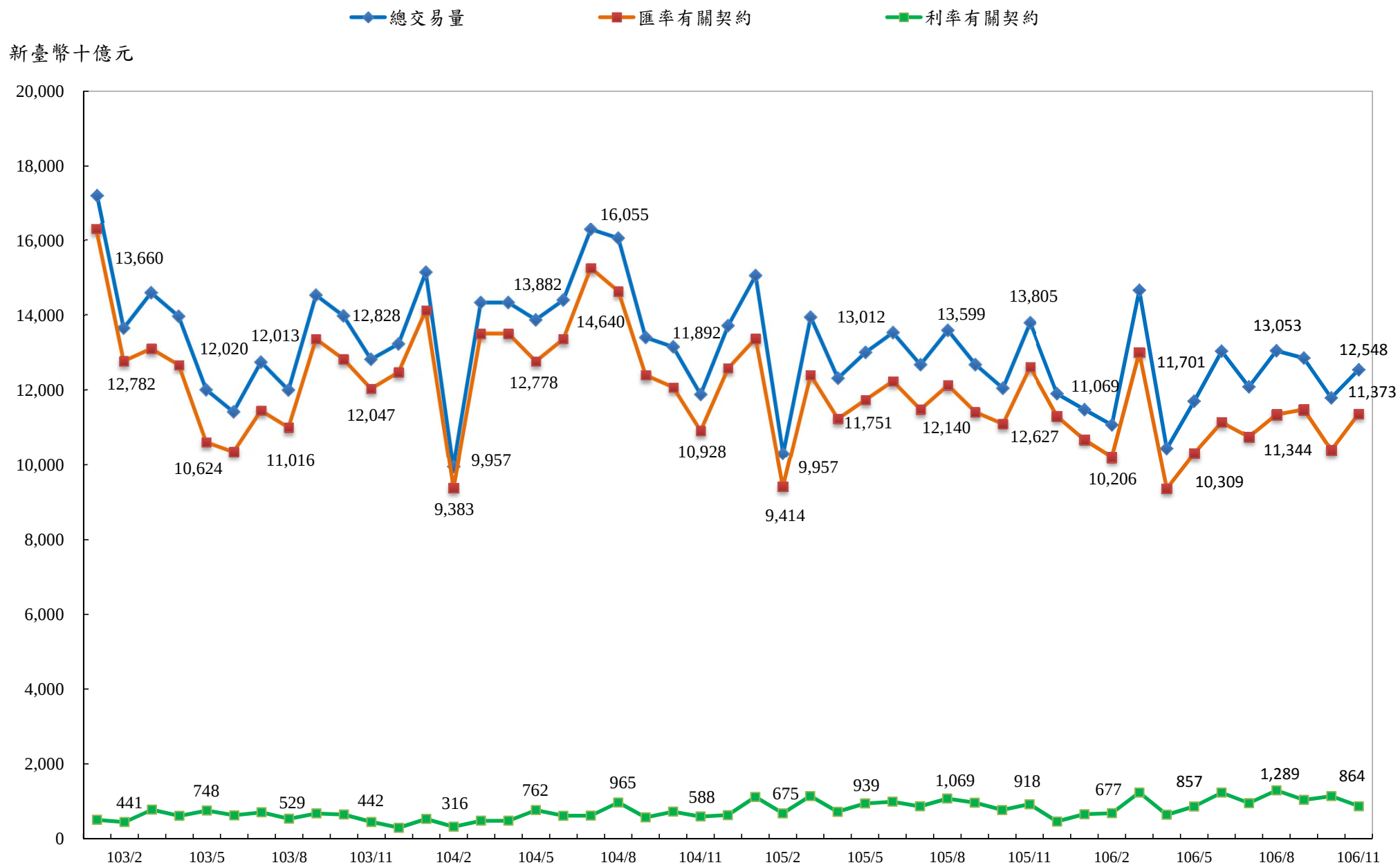
附表2 銀行衍生性金融商品交易量比較表

單位：新臺幣百萬元；%

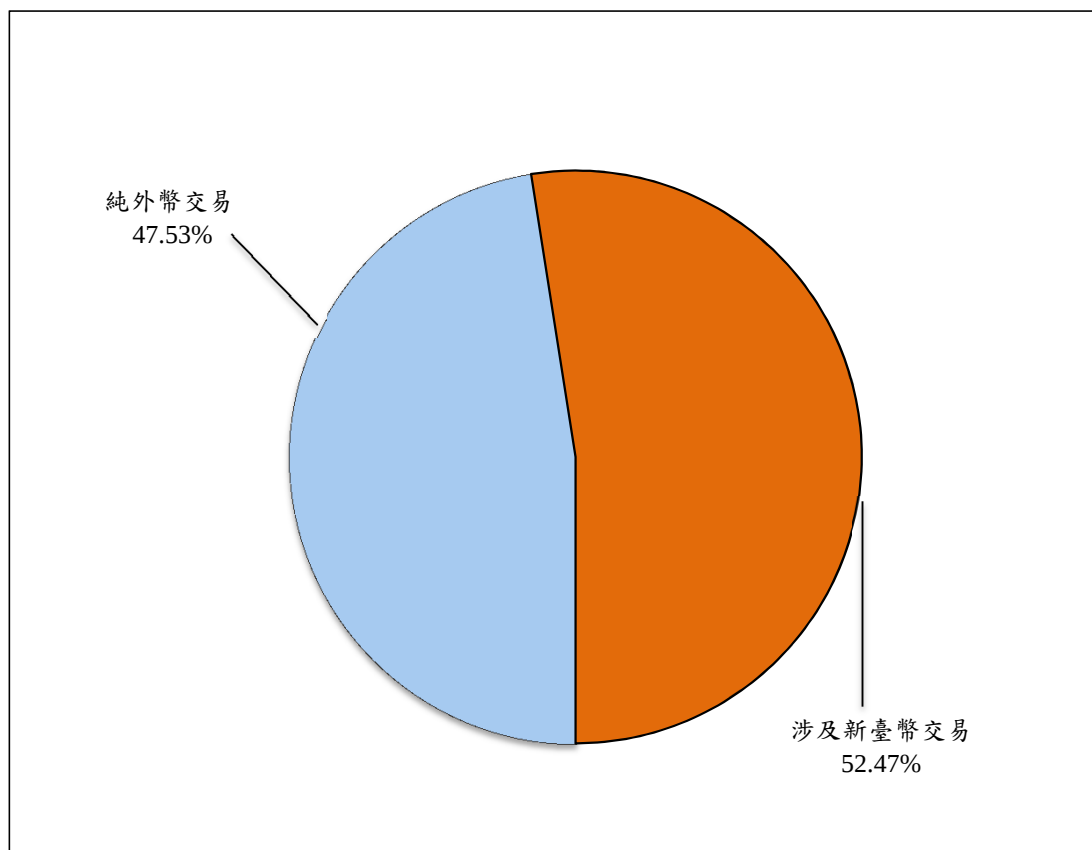
商 品 種 類	106年11月		106年10月		比較增減	
	合計	比重	合計	比重	差 額	變動率
一、利率有關契約(Interest Rate Contracts)	864,305	6.89	1,134,899	9.62	-270,594	-23.84
(一)店頭市場(OTC)	274,231	2.19	419,278	3.55	-145,047	-34.59
1. 遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-	-	-
2. 換利(IRS)	234,815	1.87	338,030	2.86	-103,215	-30.53
3. 買入選擇權(Bought Options)	9,157	0.08	1,000	0.01	8,157	815.70
4. 賣出選擇權(Sold Options)	30,259	0.24	80,248	0.68	-49,989	-62.29
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	590,074	4.70	715,621	6.07	-125,547	-17.54
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	292,485	2.33	372,982	3.16	-80,497	-21.58
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	296,581	2.36	341,915	2.90	-45,334	-13.26
3. 買入選擇權(Bought Options)	120	-	-	-	120	-
4. 賣出選擇權(Sold Options)	888	0.01	724	0.01	164	22.65
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	11,372,732	90.63	10,394,002	88.13	978,730	9.42
(一)店頭市場(OTC)	11,317,646	90.19	10,346,609	87.73	971,037	9.39
1. 遠期契約(Outright Forwards)	1,167,579	9.30	1,004,810	8.52	162,769	16.20
2. 換匯(Fx Swaps)	9,441,895	75.25	8,753,415	74.22	688,480	7.87
3. 換匯換利(Currency Swaps)	92,768	0.74	80,074	0.68	12,694	15.85
4. 買入選擇權(Bought Options)	316,687	2.52	262,620	2.23	54,067	20.59
5. 賣出選擇權(Sold Options)	298,717	2.38	245,690	2.08	53,027	21.58
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	55,086	0.44	47,393	0.40	7,693	16.23
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	21,598	0.17	18,854	0.16	2,744	14.55
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	21,210	0.17	18,210	0.15	3,000	16.47
3. 買入選擇權(Bought Options)	6,572	0.05	5,673	0.05	899	15.85
4. 賣出選擇權(Sold Options)	5,706	0.05	4,656	0.04	1,050	22.55
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	300,823	2.40	250,265	2.12	50,558	20.20
(一)店頭市場(OTC)	287	-	219	-	68	31.05
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	300,536	2.40	250,046	2.12	50,490	20.19
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	9,916	0.08	15,125	0.13	-5,209	-34.44
(一)店頭市場(OTC)	4,036	0.03	6,663	0.06	-2,627	-39.43
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	5,880	0.05	8,462	0.07	-2,582	-30.51
小 計(一至四)	12,547,776	100.00	11,794,291	100.00	753,485	6.39
五、信用有關契約(Credit Contracts)	210	-	302	-	-92	-30.46
1. 信用違約交換(Credit Default Swap)	210	-	302	-	-92	-30.46
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	12,547,986	100.00	11,794,593	100.00	753,393	6.39

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11月銀行衍生性金融商品交易量內容分析
幣別



銀行類別

