

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2月

單位：新臺幣百萬元；%

商 品 種 類	本國銀行及外國銀行在台分行 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)	222, 779	451, 906	674, 685	6. 54
(一)店頭市場(OTC)	222, 779	75, 119	297, 898	2. 88
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	376, 787	376, 787	3. 66
二、匯率有關契約²(Foreign Exchange Transactions)	4, 356, 018	5, 057, 569	9, 413, 587	91. 31
(一)店頭市場(OTC)	4, 356, 018	5, 013, 656	9, 369, 674	90. 88
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	43, 913	43, 913	0. 43
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	191, 957	13, 251	205, 208	1. 99
(一)店頭市場(OTC)	5	121	126	-
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	191, 952	13, 130	205, 082	1. 99
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	1, 110	9, 095	10, 205	0. 10
(一)店頭市場(OTC)	-	4, 305	4, 305	0. 04
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	1, 110	4, 790	5, 900	0. 06
小 計(一至四)	4, 771, 864	5, 531, 821	10, 303, 685	99. 94
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	5, 675	5, 675	0. 06
六、其他有關契約(Other Contracts)	-	-	-	-
總 計	4, 771, 864	5, 537, 496	10, 309, 360	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2月	金 額	4, 771, 864	5, 537, 496	10, 309, 360
	比 重	46. 29	53. 71	100. 00
105年1月	金 額	6, 959, 116	8, 098, 143	15, 057, 259
	比 重	46. 22	53. 78	100. 00
比較增減	差 額	-2, 187, 252	-2, 560, 647	-4, 747, 899
	變動率	-31. 43	-31. 62	-31. 53

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；%

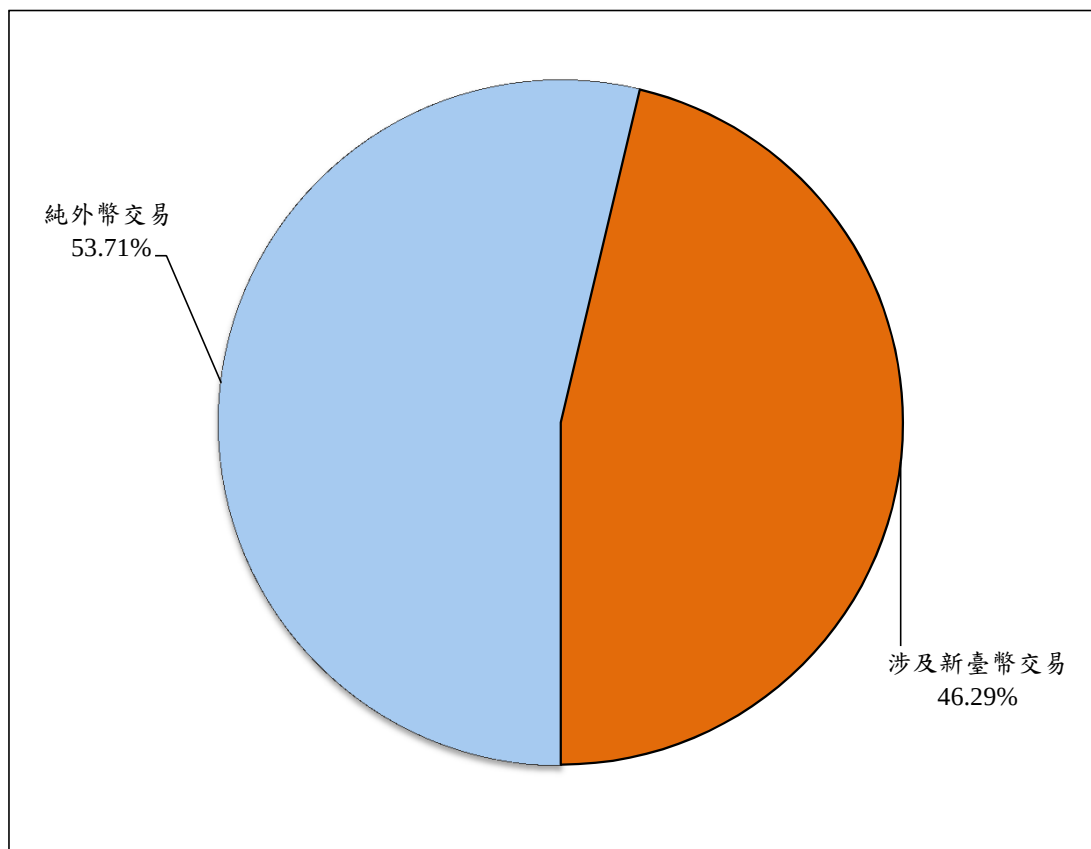
商 品 種 類	105年2月		105年1月		比較增減	
	合計	比重	合計	比重	差 額	變動率
一、利率有關契約(Interest Rate Contracts)	674,685	6.54	1,113,615	7.40	-438,930	-39.41
(一)店頭市場(OTC)	297,898	2.88	422,159	2.81	-124,261	-29.43
1. 遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-	-	-
2. 換利(IRS)	290,176	2.81	412,154	2.74	-121,978	-29.60
3. 買入選擇權(Bought Options)	1,139	0.01	1,351	0.01	-212	-15.69
4. 賣出選擇權(Sold Options)	6,583	0.06	8,654	0.06	-2,071	-23.93
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	376,787	3.66	691,456	4.59	-314,669	-45.51
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	202,765	1.97	322,271	2.14	-119,506	-37.08
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	173,970	1.69	367,974	2.44	-194,004	-52.72
3. 買入選擇權(Bought Options)	52	-	1,194	0.01	-1,142	-95.64
4. 賣出選擇權(Sold Options)	-	-	17	-	-17	-100.00
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	9,413,587	91.31	13,383,339	88.88	-3,969,752	-29.66
(一)店頭市場(OTC)	9,369,674	90.88	13,248,663	87.99	-3,878,989	-29.28
1. 遠期契約(Outright Forwards)	1,256,001	12.18	1,418,336	9.42	-162,335	-11.45
2. 換匯(Fx Swaps)	6,929,494	67.22	9,887,040	65.66	-2,957,546	-29.91
3. 換匯換利(Currency Swaps)	70,144	0.68	88,289	0.59	-18,145	-20.55
4. 買入選擇權(Bought Options)	562,215	5.45	931,480	6.19	-369,265	-39.64
5. 賣出選擇權(Sold Options)	551,820	5.35	923,518	6.13	-371,698	-40.25
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	43,913	0.43	134,676	0.89	-90,763	-67.39
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	22,404	0.22	67,154	0.44	-44,750	-66.64
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	21,509	0.21	67,522	0.45	-46,013	-68.15
3. 買入選擇權(Bought Options)	-	-	-	-	-	-
4. 賣出選擇權(Sold Options)	-	-	-	-	-	-
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	205,208	1.99	534,596	3.55	-329,388	-61.61
(一)店頭市場(OTC)	126	-	300	-	-174	-58.00
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	205,082	1.99	534,296	3.55	-329,214	-61.62
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	10,205	0.10	19,044	0.13	-8,839	-46.41
(一)店頭市場(OTC)	4,305	0.04	7,666	0.05	-3,361	-43.84
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	5,900	0.06	11,378	0.08	-5,478	-48.15
小 計(一至四)	10,303,685	99.94	15,050,594	99.96	-4,746,909	-31.54
五、信用有關契約(Credit Contracts)	5,675	0.06	6,665	0.04	-990	-14.85
1. 信用違約交換(Credit Default Swap)	5,675	0.06	6,665	0.04	-990	-14.85
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	10,309,360	100.00	15,057,259	100.00	-4,747,899	-31.53

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2月銀行衍生性金融商品交易量內容分析
幣別



銀行類別

