

附表1 銀行衍生性金融商品交易量彙總表

商 品 種 類 別

104年11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)	230, 441	357, 659	588, 100	4. 95
(一)店頭市場(OTC)	230, 441	113, 453	343, 894	2. 89
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	244, 206	244, 206	2. 06
二、匯率有關契約 ² (Foreign Exchange Transactions)	4, 587, 766	6, 340, 564	10, 928, 330	91. 89
(一)店頭市場(OTC)	4, 587, 766	6, 226, 966	10, 814, 732	90. 94
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	113, 598	113, 598	0. 95
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	354, 358	5, 533	359, 891	3. 02
(一)店頭市場(OTC)	91	444	535	-
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	354, 267	5, 089	359, 356	3. 02
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	606	13, 108	13, 714	0. 12
(一)店頭市場(OTC)	-	8, 086	8, 086	0. 07
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	606	5, 022	5, 628	0. 05
小 計(一至四)	5, 173, 171	6, 716, 864	11, 890, 035	99. 98
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	2, 213	2, 213	0. 02
六、其他有關契約(Other Contracts)	-	-	-	-
總 計	5, 173, 171	6, 719, 077	11, 892, 248	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
104年11月	金 額	5, 173, 171	6, 719, 077	11, 892, 248
	比 重	43. 50	56. 50	100. 00
104年10月	金 額	5, 280, 454	7, 880, 279	13, 160, 733
	比 重	40. 12	59. 88	100. 00
比較增減	差 額	-107, 283	-1, 161, 202	-1, 268, 485
	變動率	-2. 03	-14. 74	-9. 64

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；%

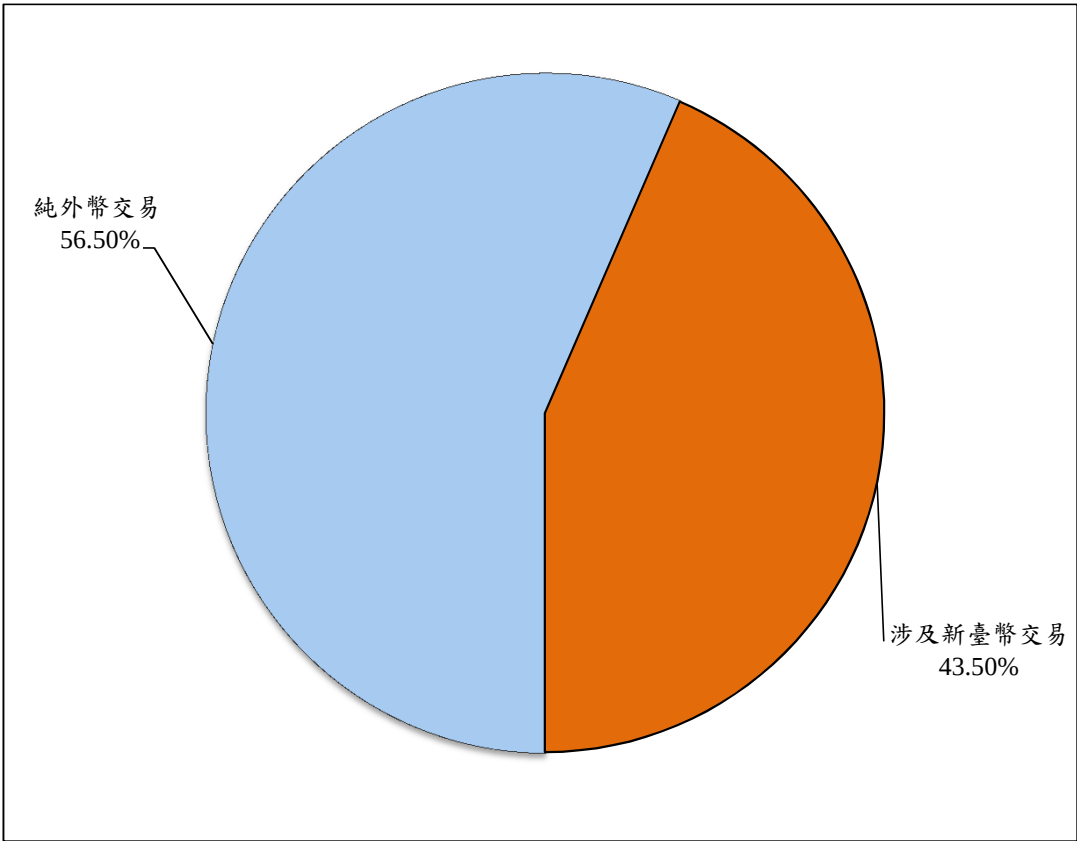
商 品 種 類	104年11月		104年10月		比較增減	
	合計	比重	合計	比重	差 額	變動率
一、利率有關契約(Interest Rate Contracts)	588,100	4.95	719,444	5.46	-131,344	-18.26
(一)店頭市場(OTC)	343,894	2.89	311,080	2.36	32,814	10.55
1. 遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-	-	-
2. 換利(IRS)	336,915	2.83	305,564	2.32	31,351	10.26
3. 買入選擇權(Bought Options)	1,534	0.01	1,102	0.01	432	39.20
4. 賣出選擇權(Sold Options)	5,445	0.05	4,414	0.03	1,031	23.36
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	244,206	2.06	408,364	3.10	-164,158	-40.20
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	113,907	0.96	205,537	1.56	-91,630	-44.58
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	127,537	1.08	202,826	1.54	-75,289	-37.12
3. 買入選擇權(Bought Options)	2,015	0.02	1	-	2,014	201,400.00
4. 賣出選擇權(Sold Options)	747	-	-	-	747	-
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	10,928,330	91.89	12,085,445	91.83	-1,157,115	-9.57
(一)店頭市場(OTC)	10,814,732	90.94	11,358,567	86.31	-543,835	-4.79
1. 遠期契約(Outright Forwards)	961,604	8.09	1,077,487	8.19	-115,883	-10.75
2. 換匯(Fx Swaps)	8,041,382	67.62	8,283,112	62.94	-241,730	-2.92
3. 換匯換利(Currency Swaps)	99,134	0.83	105,121	0.80	-5,987	-5.70
4. 買入選擇權(Bought Options)	874,969	7.36	965,680	7.34	-90,711	-9.39
5. 賣出選擇權(Sold Options)	837,643	7.04	927,167	7.04	-89,524	-9.66
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	113,598	0.95	726,878	5.52	-613,280	-84.37
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	56,909	0.48	363,340	2.76	-306,431	-84.34
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	56,689	0.47	363,538	2.76	-306,849	-84.41
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)	359,891	3.02	308,754	2.35	51,137	16.56
(一)店頭市場(OTC)	535	-	388	-	147	37.89
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	359,356	3.02	308,366	2.35	50,990	16.54
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	13,714	0.12	45,251	0.35	-31,537	-69.69
(一)店頭市場(OTC)	8,086	0.07	8,963	0.07	-877	-9.78
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	5,628	0.05	36,288	0.28	-30,660	-84.49
小 計(一至四)	11,890,035	99.98	13,158,894	99.99	-1,268,859	-9.64
五、信用有關契約(Credit Contracts)	2,213	0.02	1,839	0.01	374	20.34
1. 信用違約交換(Credit Default Swap)	2,213	0.02	1,839	0.01	374	20.34
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	11,892,248	100.00	13,160,733	100.00	-1,268,485	-9.64

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2 104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

