

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12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)	257, 296	369, 456	626, 752	4. 57
（一）店頭市場(OTC)	257, 283	81, 987	339, 270	2. 47
（二）交易所(Exchange-traded Contracts)	13	287, 469	287, 482	2. 10
二、匯率有關契約 ² (Foreign Exchange Transactions)	5, 544, 233	7, 047, 968	12, 592, 201	91. 75
（一）店頭市場(OTC)	5, 544, 233	6, 565, 999	12, 110, 232	88. 24
（二）交易所(Exchange-traded Contracts)	-	481, 969	481, 969	3. 51
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	483, 081	8, 047	491, 128	3. 58
（一）店頭市場(OTC)	30	563	593	0. 01
（二）交易所(Exchange-traded Contracts)	483, 051	7, 484	490, 535	3. 57
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	745	11, 921	12, 666	0. 09
（一）店頭市場(OTC)	-	8, 618	8, 618	0. 06
（二）交易所(Exchange-traded Contracts)	745	3, 303	4, 048	0. 03
小 計(一至四)	6, 285, 355	7, 437, 392	13, 722, 747	99. 99
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	1, 173	1, 173	0. 01
六、其他有關契約(Other Contracts)	-	-	-	-
總 計	6, 285, 355	7, 438, 565	13, 723, 920	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12月	金 額	6, 285, 355	7, 438, 565	13, 723, 920
	比 重	45. 80	54. 20	100. 00
104年11月	金 額	5, 173, 171	6, 719, 077	11, 892, 248
	比 重	43. 50	56. 50	100. 00
比較增減	差 額	1, 112, 184	719, 488	1, 831, 672
	變動率	21. 50	10. 71	15. 40

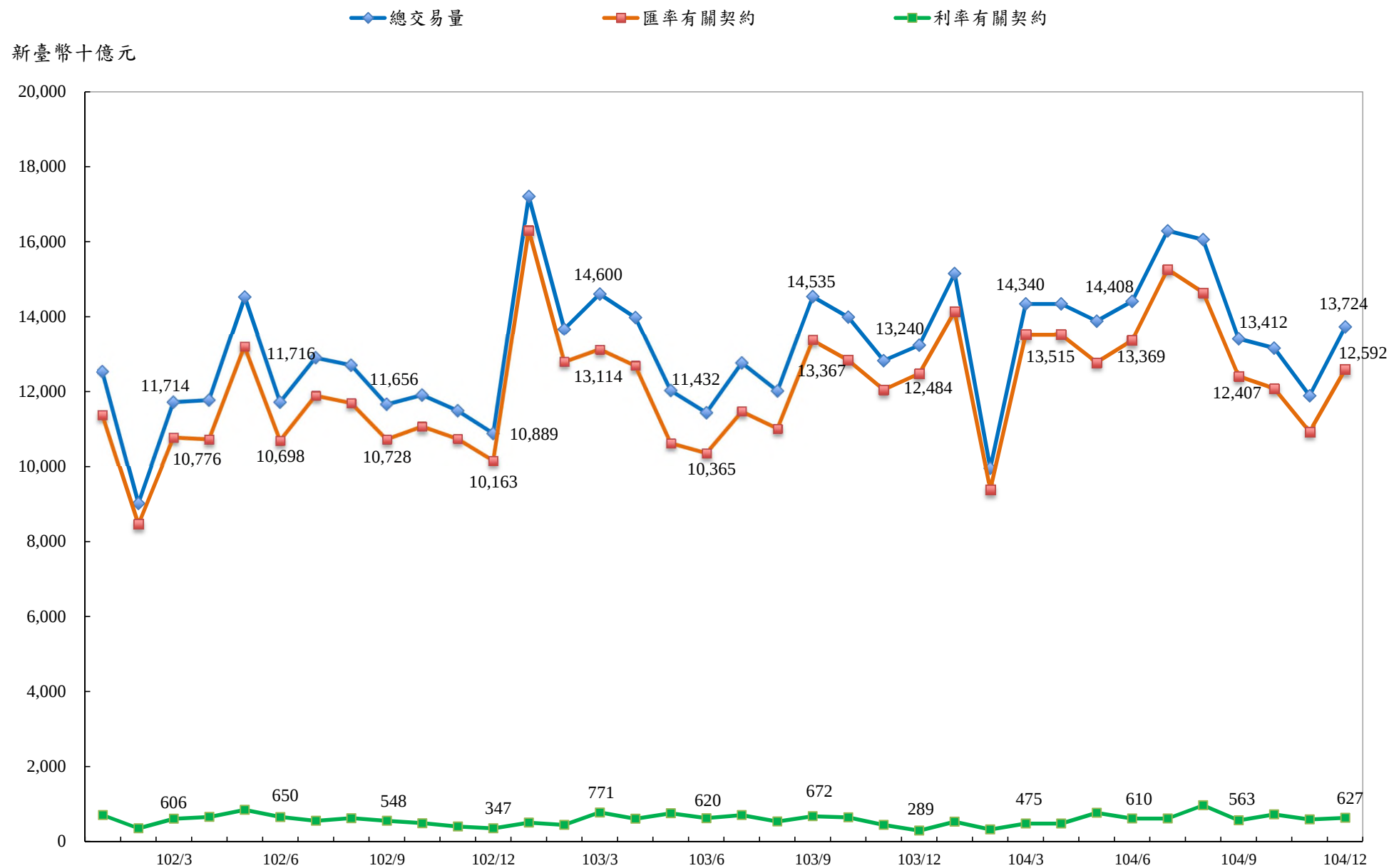
附表2 銀行衍生性金融商品交易量比較表

單位：新臺幣百萬元；%

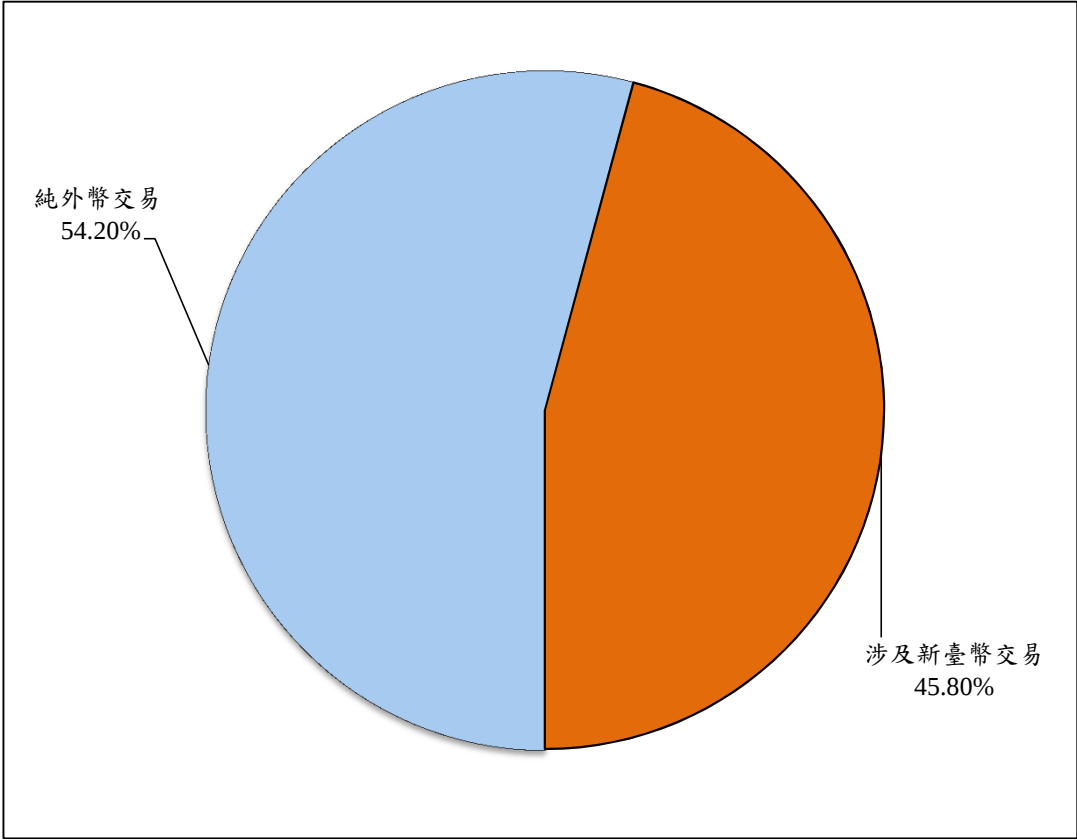
商 品 種 類	104年12月		104年11月		比較增減	
	合計	比重	合計	比重	差 額	變動率
一、利率有關契約(Interest Rate Contracts)	626,752	4.57	588,100	4.95	38,652	6.57
(一)店頭市場(OTC)	339,270	2.47	343,894	2.89	-4,624	-1.34
1. 遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-	-	-
2. 換利(IRS)	334,872	2.44	336,915	2.83	-2,043	-0.61
3. 買入選擇權(Bought Options)	437	-	1,534	0.01	-1,097	-71.51
4. 賣出選擇權(Sold Options)	3,961	0.03	5,445	0.05	-1,484	-27.25
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	287,482	2.10	244,206	2.06	43,276	17.72
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	149,792	1.09	113,907	0.96	35,885	31.50
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	133,874	0.98	127,537	1.08	6,337	4.97
3. 買入選擇權(Bought Options)	1,661	0.01	2,015	0.02	-354	-17.57
4. 賣出選擇權(Sold Options)	2,155	0.02	747	-	1,408	188.49
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	12,592,201	91.75	10,928,330	91.89	1,663,871	15.23
(一)店頭市場(OTC)	12,110,232	88.24	10,814,732	90.94	1,295,500	11.98
1. 遠期契約(Outright Forwards)	1,182,528	8.62	961,604	8.09	220,924	22.97
2. 換匯(Fx Swaps)	9,656,575	70.36	8,041,382	67.62	1,615,193	20.09
3. 換匯換利(Currency Swaps)	70,143	0.51	99,134	0.83	-28,991	-29.24
4. 買入選擇權(Bought Options)	614,873	4.48	874,969	7.36	-260,096	-29.73
5. 賣出選擇權(Sold Options)	586,113	4.27	837,643	7.04	-251,530	-30.03
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	481,969	3.51	113,598	0.95	368,371	324.28
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	240,322	1.75	56,909	0.48	183,413	322.29
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	241,647	1.76	56,689	0.47	184,958	326.27
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)	491,128	3.58	359,891	3.02	131,237	36.47
(一)店頭市場(OTC)	593	0.01	535	-	58	10.84
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	490,535	3.57	359,356	3.02	131,179	36.50
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	12,666	0.09	13,714	0.12	-1,048	-7.64
(一)店頭市場(OTC)	8,618	0.06	8,086	0.07	532	6.58
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	4,048	0.03	5,628	0.05	-1,580	-28.07
小 計(一至四)	13,722,747	99.99	11,890,035	99.98	1,832,712	15.41
五、信用有關契約(Credit Contracts)	1,173	0.01	2,213	0.02	-1,040	-47.00
1. 信用違約交換(Credit Default Swap)	1,173	0.01	2,213	0.02	-1,040	-47.00
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	13,723,920	100.00	11,892,248	100.00	1,831,672	15.40

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12月銀行衍生性金融商品交易量內容分析
幣別



銀行類別

