

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7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)	87,103	859,361	946,464	7.83
(一)店頭市場(OTC)	87,025	103,098	190,123	1.57
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	78	756,263	756,341	6.26
二、匯率有關契約²(Foreign Exchange Transactions)	5,831,589	4,914,166	10,745,755	88.90
(一)店頭市場(OTC)	5,831,589	4,843,581	10,675,170	88.32
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	70,585	70,585	0.58
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	379,410	5,846	385,256	3.19
(一)店頭市場(OTC)	-	54	54	-
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	379,410	5,792	385,202	3.19
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	645	9,037	9,682	0.08
(一)店頭市場(OTC)	-	6,313	6,313	0.05
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	645	2,724	3,369	0.03
小 計(一至四)	6,298,747	5,788,410	12,087,157	100.00
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	302	302	-
六、其他有關契約(Other Contracts)	-	-	-	-
總 計	6,298,747	5,788,712	12,087,459	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7月	金 額	6,298,747	5,788,712	12,087,459
	比 重	52.11	47.89	100.00
106年6月	金 額	6,719,007	6,325,626	13,044,633
	比 重	51.51	48.49	100.00
比較增減	差 額	-420,260	-536,914	-957,174
	變動率	-6.25	-8.49	-7.34

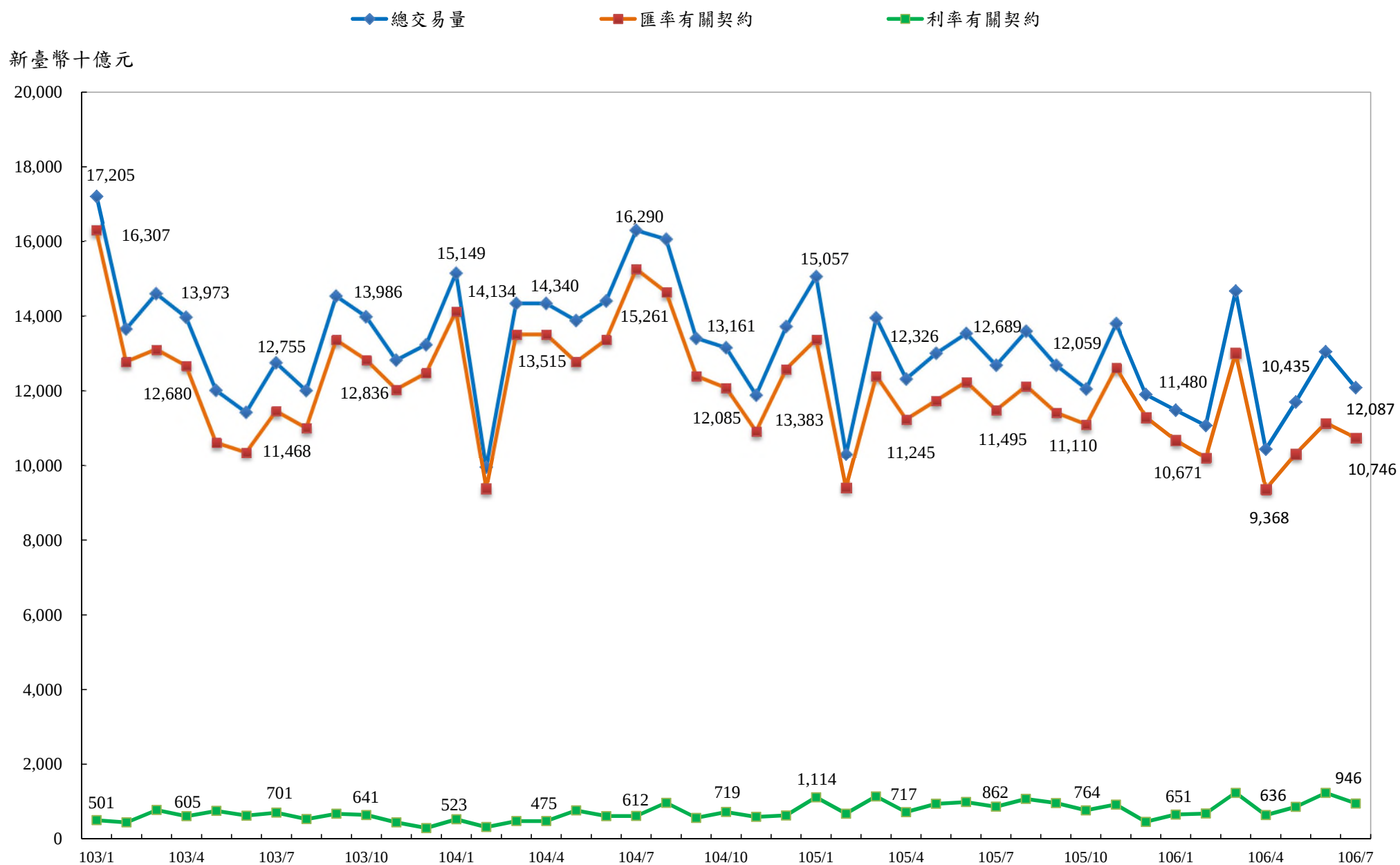
附表2 銀行衍生性金融商品交易量比較表

單位：新臺幣百萬元；%

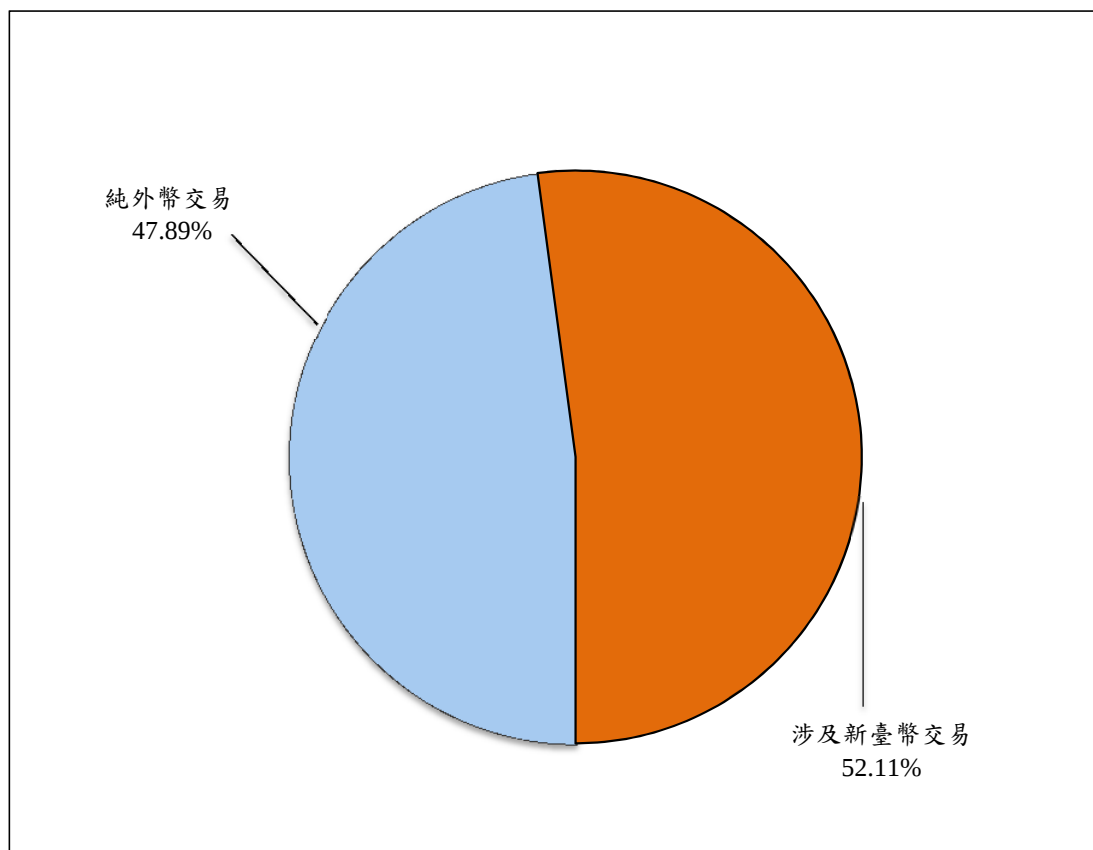
商 品 種 類	106年7月		106年6月		比較增減	
	合計	比重	合計	比重	差 額	變動率
一、利率有關契約(Interest Rate Contracts)	946,464	7.83	1,229,234	9.42	-282,770	-23.00
(一)店頭市場(OTC)	190,123	1.57	344,349	2.64	-154,226	-44.79
1. 遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-	-	-
2. 換利(IRS)	176,283	1.46	328,612	2.52	-152,329	-46.36
3. 買入選擇權(Bought Options)	-	-	517	-	-517	-100.00
4. 賣出選擇權(Sold Options)	13,840	0.11	15,220	0.12	-1,380	-9.07
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	756,341	6.26	884,885	6.78	-128,544	-14.53
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	359,605	2.98	437,599	3.36	-77,994	-17.82
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	396,658	3.28	446,361	3.42	-49,703	-11.14
3. 買入選擇權(Bought Options)	-	-	426	-	-426	-100.00
4. 賣出選擇權(Sold Options)	78	-	499	-	-421	-84.37
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	10,745,755	88.90	11,138,675	85.39	-392,920	-3.53
(一)店頭市場(OTC)	10,675,170	88.32	11,077,241	84.92	-402,071	-3.63
1. 遠期契約(Outright Forwards)	1,015,815	8.41	1,163,859	8.92	-148,044	-12.72
2. 換匯(Fx Swaps)	8,957,957	74.11	9,064,024	69.49	-106,067	-1.17
3. 換匯換利(Currency Swaps)	155,808	1.29	174,218	1.34	-18,410	-10.57
4. 買入選擇權(Bought Options)	280,598	2.32	348,576	2.67	-67,978	-19.50
5. 賣出選擇權(Sold Options)	264,992	2.19	326,564	2.50	-61,572	-18.85
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	70,585	0.58	61,434	0.47	9,151	14.90
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	28,427	0.24	23,476	0.18	4,951	21.09
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	28,119	0.23	23,654	0.18	4,465	18.88
3. 買入選擇權(Bought Options)	7,788	0.06	7,613	0.06	175	2.30
4. 賣出選擇權(Sold Options)	6,251	0.05	6,691	0.05	-440	-6.58
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	385,256	3.19	661,300	5.07	-276,044	-41.74
(一)店頭市場(OTC)	54	-	388	-	-334	-86.08
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	385,202	3.19	660,912	5.07	-275,710	-41.72
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	9,682	0.08	10,695	0.08	-1,013	-9.47
(一)店頭市場(OTC)	6,313	0.05	7,223	0.05	-910	-12.60
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	3,369	0.03	3,472	0.03	-103	-2.97
小 計(一至四)	12,087,157	100.00	13,039,904	99.96	-952,747	-7.31
五、信用有關契約(Credit Contracts)	302	-	4,729	0.04	-4,427	-93.61
1. 信用違約交換(Credit Default Swap)	302	-	4,729	0.04	-4,427	-93.61
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	12,087,459	100.00	13,044,633	100.00	-957,174	-7.34

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7月銀行衍生性金融商品交易量內容分析
幣別



銀行類別

