

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9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)	217, 779	345, 460	563, 239	4. 20
(一)店頭市場(OTC)	217, 779	68, 340	286, 119	2. 13
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	277, 120	277, 120	2. 07
二、匯率有關契約 ² (Foreign Exchange Transactions)	4, 951, 477	7, 455, 668	12, 407, 145	92. 51
(一)店頭市場(OTC)	4, 951, 477	7, 162, 568	12, 114, 045	90. 32
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	293, 100	293, 100	2. 19
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	387, 816	12, 236	400, 052	2. 98
(一)店頭市場(OTC)	50	197	247	-
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	387, 766	12, 039	399, 805	2. 98
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	516	37, 210	37, 726	0. 28
(一)店頭市場(OTC)	-	12, 256	12, 256	0. 09
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	516	24, 954	25, 470	0. 19
小 計(一至四)	5, 557, 588	7, 850, 574	13, 408, 162	99. 97
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	3, 779	3, 779	0. 03
六、其他有關契約(Other Contracts)	-	-	-	-
總 計	5, 557, 588	7, 854, 353	13, 411, 941	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9月	金 額	5, 557, 588	7, 854, 353	13, 411, 941
	比 重	41. 44	58. 56	100. 00
104年8月	金 額	5, 906, 433	10, 148, 108	16, 054, 541
	比 重	36. 79	63. 21	100. 00
比較增減	差 額	-348, 845	-2, 293, 755	-2, 642, 600
	變動率	-5. 91	-22. 60	-16. 46

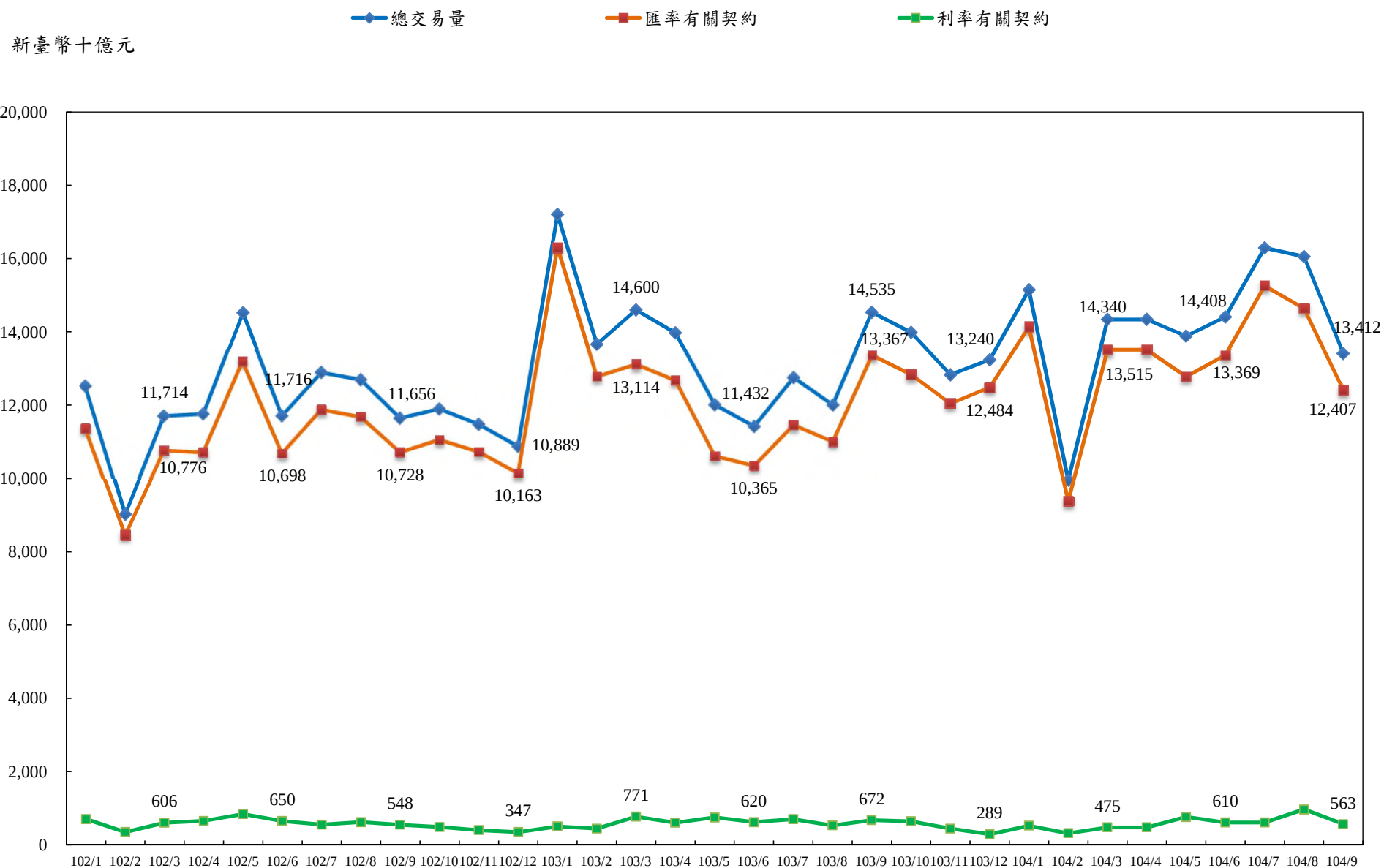
附表2 銀行衍生性金融商品交易量比較表

單位：新臺幣百萬元；%

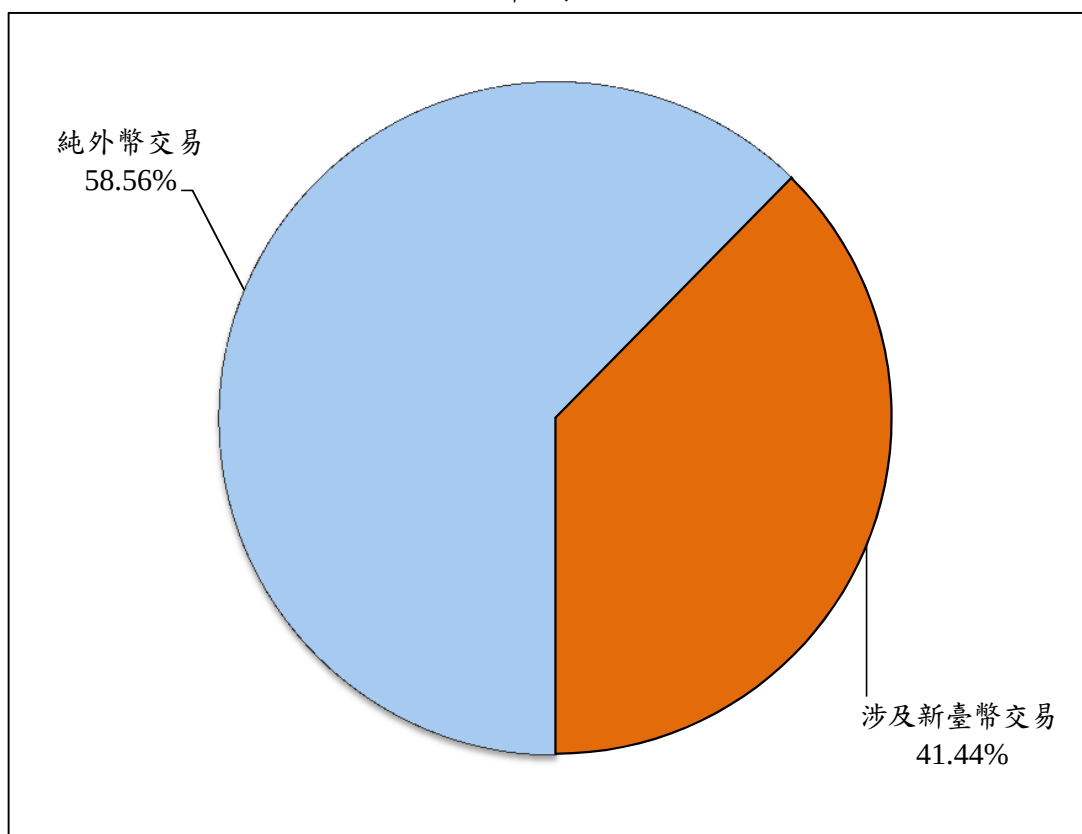
商 品 種 類	104年9月		104年8月		比較增減	
	合計	比重	合計	比重	差 額	變動率
一、利率有關契約(Interest Rate Contracts)	563,239	4.20	964,876	6.01	-401,637	-41.63
(一)店頭市場(OTC)	286,119	2.13	525,808	3.28	-239,689	-45.58
1.遠期利率協議(FRA)	918	0.01	65,616	0.41	-64,698	-98.60
2.換利(IRS)	276,942	2.06	447,579	2.79	-170,637	-38.12
3.買入選擇權(Bought Options)	2,052	0.01	1,848	0.01	204	11.04
4.賣出選擇權(Sold Options)	6,207	0.05	10,765	0.07	-4,558	-42.34
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	277,120	2.07	439,068	2.73	-161,948	-36.88
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	135,980	1.02	223,249	1.39	-87,269	-39.09
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	141,137	1.05	215,160	1.34	-74,023	-34.40
3.買入選擇權(Bought Options)	2	-	658	-	-656	-99.70
4.賣出選擇權(Sold Options)	1	-	1	-	-	-
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	12,407,145	92.51	14,640,310	91.19	-2,233,165	-15.25
(一)店頭市場(OTC)	12,114,045	90.32	14,223,262	88.59	-2,109,217	-14.83
1.遠期契約(Outright Forwards)	1,194,265	8.90	1,833,566	11.42	-639,301	-34.87
2.換匯(Fx Swaps)	9,101,010	67.86	9,782,424	60.93	-681,414	-6.97
3.換匯換利(Currency Swaps)	70,476	0.53	73,610	0.46	-3,134	-4.26
4.買入選擇權(Bought Options)	916,233	6.83	1,282,325	7.99	-366,092	-28.55
5.賣出選擇權(Sold Options)	832,061	6.20	1,251,337	7.79	-419,276	-33.51
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	293,100	2.19	417,048	2.60	-123,948	-29.72
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	143,938	1.08	208,419	1.30	-64,481	-30.94
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	149,162	1.11	208,629	1.30	-59,467	-28.50
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)	400,052	2.98	422,839	2.64	-22,787	-5.39
(一)店頭市場(OTC)	247	-	359	-	-112	-31.20
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	399,805	2.98	422,480	2.64	-22,675	-5.37
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	37,726	0.28	21,020	0.13	16,706	79.48
(一)店頭市場(OTC)	12,256	0.09	12,699	0.08	-443	-3.49
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	25,470	0.19	8,321	0.05	17,149	206.09
小 計(一至四)	13,408,162	99.97	16,049,045	99.97	-2,640,883	-16.46
五、信用有關契約(Credit Contracts)	3,779	0.03	5,496	0.03	-1,717	-31.24
1.信用違約交換(Credit Default Swap)	3,779	0.03	5,496	0.03	-1,717	-31.24
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	13,411,941	100.00	16,054,541	100.00	-2,642,600	-16.46

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9月銀行衍生性金融商品交易量內容分析
幣別



銀行類別

