

附表1 銀行衍生性金融商品交易量彙總表
商 品 種 類 別

107年4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)	277, 075	1, 097, 337	1, 374, 412	10. 08
（一）店頭市場(OTC)	276, 863	220, 245	497, 108	3. 65
（二）交易所(Exchange-traded Contracts)	212	877, 092	877, 304	6. 43
二、匯率有關契約²(Foreign Exchange Transactions)	6, 202, 048	5, 672, 312	11, 874, 360	87. 13
（一）店頭市場(OTC)	6, 202, 048	5, 542, 526	11, 744, 574	86. 18
（二）交易所(Exchange-traded Contracts)	-	129, 786	129, 786	0. 95
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	337, 716	21, 495	359, 211	2. 64
（一）店頭市場(OTC)	-	2, 179	2, 179	0. 02
（二）交易所(Exchange-traded Contracts)	337, 716	19, 316	357, 032	2. 62
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	783	13, 489	14, 272	0. 10
（一）店頭市場(OTC)	-	9, 309	9, 309	0. 07
（二）交易所(Exchange-traded Contracts)	783	4, 180	4, 963	0. 03
小 計(一至四)	6, 817, 622	6, 804, 633	13, 622, 255	99. 95
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	6, 567	6, 567	0. 05
六、其他有關契約(Other Contracts)	-	-	-	-
總 計	6, 817, 622	6, 811, 200	13, 628, 822	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
107年4月	金 額	6, 817, 622	6, 811, 200	13, 628, 822
	比 重	50. 02	49. 98	100. 00
107年3月	金 額	7, 437, 410	8, 030, 132	15, 467, 542
	比 重	48. 08	51. 92	100. 00
比較增減	差 額	-619, 788	-1, 218, 932	-1, 838, 720
	變動率	-8. 33	-15. 18	-11. 89

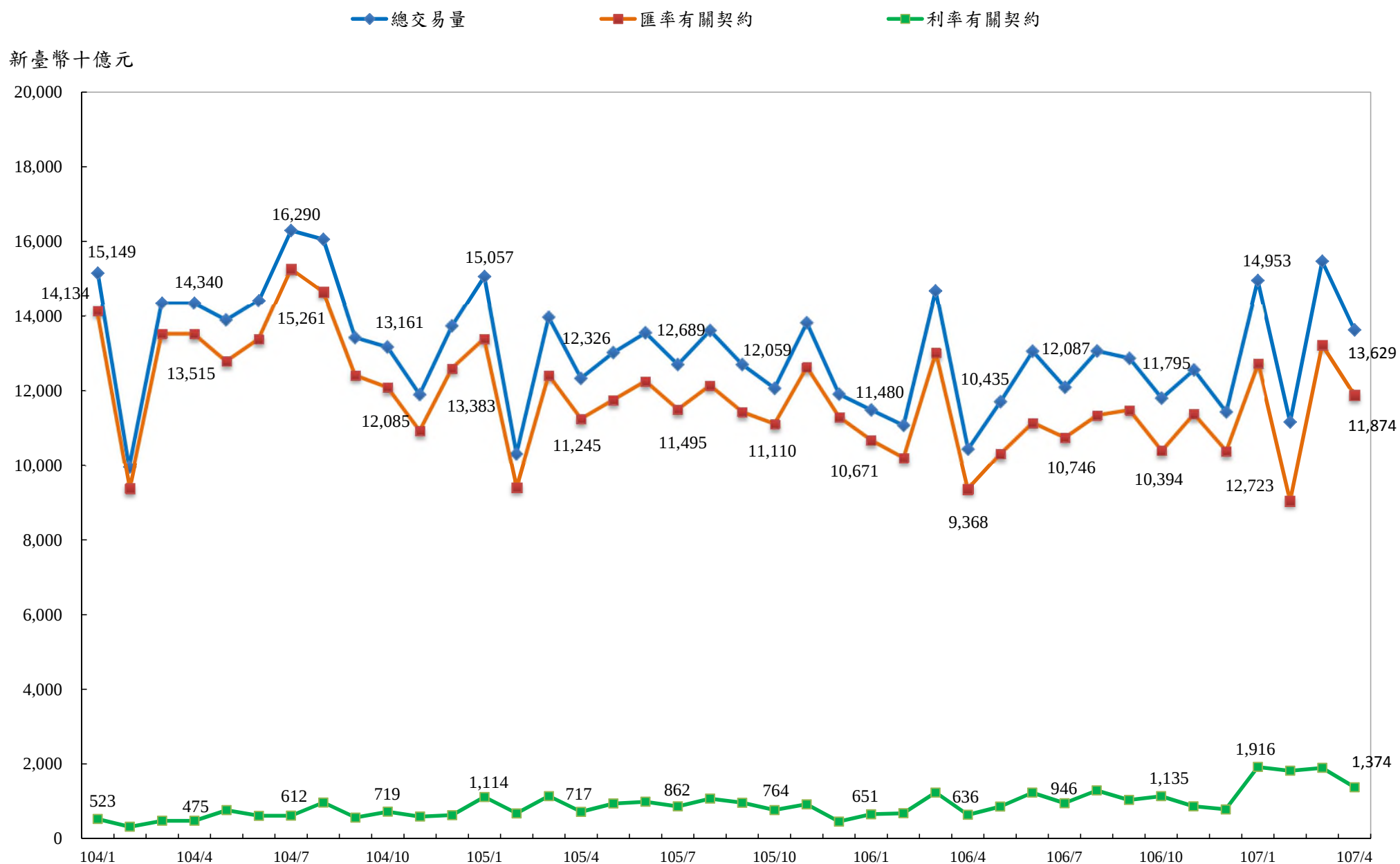
附表2 銀行衍生性金融商品交易量比較表

單位：新臺幣百萬元；%

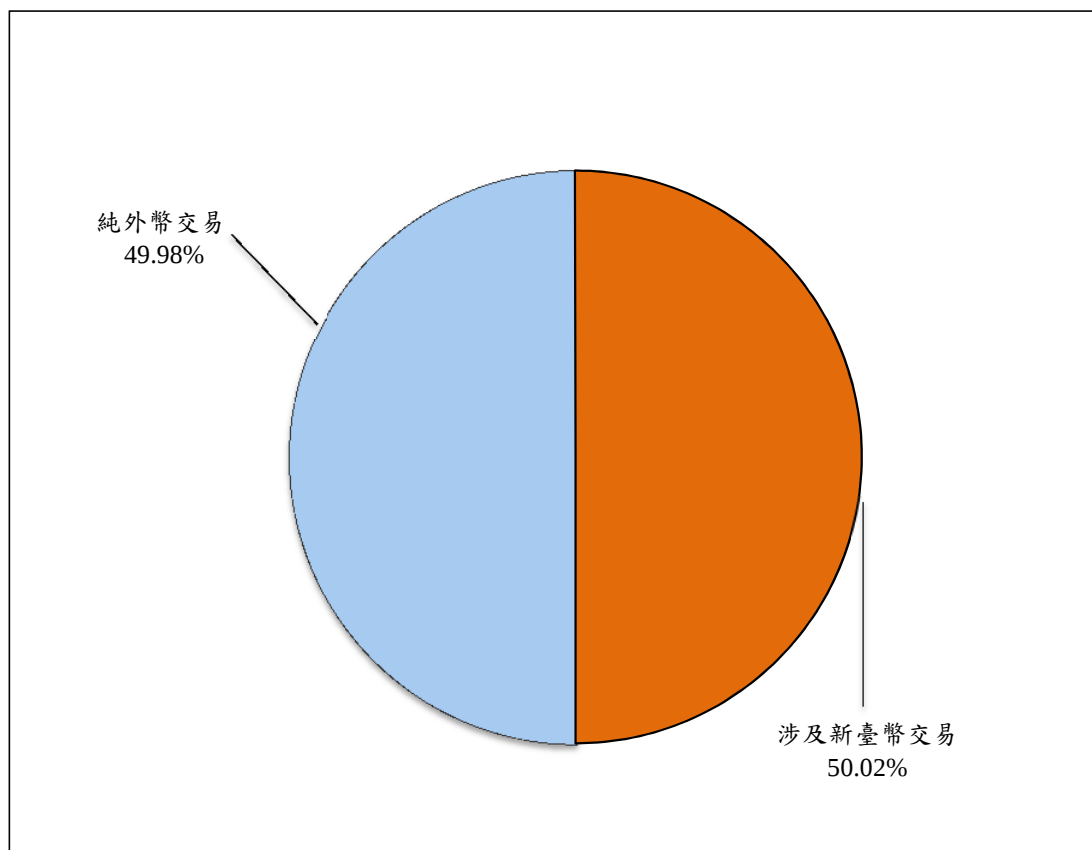
商 品 種 類	107年4月		107年3月		比較增減	
	合計	比重	合計	比重	差 額	變動率
一、利率有關契約(Interest Rate Contracts)	1,374,412	10.08	1,892,840	12.24	-518,428	-27.39
(一)店頭市場(OTC)	497,108	3.65	718,903	4.65	-221,795	-30.85
1. 遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-	-	-
2. 換利(IRS)	450,587	3.31	555,596	3.59	-105,009	-18.90
3. 買入選擇權(Bought Options)	164	0.00	59,603	0.39	-59,439	-99.72
4. 賣出選擇權(Sold Options)	46,357	0.34	103,704	0.67	-57,347	-55.30
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	877,304	6.43	1,173,937	7.59	-296,633	-25.27
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	463,155	3.40	609,233	3.94	-146,078	-23.98
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	413,937	3.03	563,609	3.65	-149,672	-26.56
3. 買入選擇權(Bought Options)	-	-	553	-	-553	-
4. 賣出選擇權(Sold Options)	212	-	542	-	-330	-60.89
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	11,874,360	87.13	13,226,150	85.51	-1,351,790	-10.22
(一)店頭市場(OTC)	11,744,574	86.18	13,174,407	85.18	-1,429,833	-10.85
1. 遠期契約(Outright Forwards)	1,284,011	9.42	1,208,865	7.82	75,146	6.22
2. 換匯(Fx Swaps)	9,675,534	71.00	11,116,331	71.87	-1,440,797	-12.96
3. 換匯換利(Currency Swaps)	171,866	1.26	156,622	1.01	15,244	9.73
4. 買入選擇權(Bought Options)	314,880	2.31	351,721	2.28	-36,841	-10.47
5. 賣出選擇權(Sold Options)	298,283	2.19	340,868	2.20	-42,585	-12.49
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	129,786	0.95	51,743	0.33	78,043	150.83
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	53,420	0.39	18,800	0.12	34,620	184.15
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	52,132	0.38	22,213	0.14	29,919	134.69
3. 買入選擇權(Bought Options)	13,686	0.10	6,129	0.04	7,557	123.30
4. 賣出選擇權(Sold Options)	10,548	0.08	4,601	0.03	5,947	129.25
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	359,211	2.64	321,324	2.07	37,887	11.79
(一)店頭市場(OTC)	2,179	0.02	2,353	0.01	-174	-7.39
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	357,032	2.62	318,971	2.06	38,061	11.93
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	14,272	0.10	13,908	0.09	364	2.62
(一)店頭市場(OTC)	9,309	0.07	7,936	0.05	1,373	17.30
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	4,963	0.03	5,972	0.04	-1,009	-16.90
小 計(一至四)	13,622,255	99.95	15,454,222	99.91	-1,831,967	-11.85
五、信用有關契約(Credit Contracts)	6,567	0.05	13,320	0.09	-6,753	-50.70
1. 信用違約交換(Credit Default Swap)	6,567	0.05	13,320	0.09	-6,753	-50.70
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	13,628,822	100.00	15,467,542	100.00	-1,838,720	-11.89

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2 107年4月銀行衍生性金融商品交易量內容分析
幣別



銀行類別

