

附表1 銀行衍生性金融商品交易量彙總表
商 品 種 類 別

105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)	237, 717	478, 813	716, 530	5. 82
(一)店頭市場(OTC)	237, 717	132, 757	370, 474	3. 01
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	346, 056	346, 056	2. 81
二、匯率有關契約²(Foreign Exchange Transactions)	5, 359, 352	5, 886, 042	11, 245, 394	91. 23
(一)店頭市場(OTC)	5, 348, 232	5, 854, 872	11, 203, 104	90. 89
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	11, 120	31, 170	42, 290	0. 34
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	321, 492	6, 098	327, 590	2. 66
(一)店頭市場(OTC)	77	176	253	-
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	321, 415	5, 922	327, 337	2. 66
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	708	32, 590	33, 298	0. 27
(一)店頭市場(OTC)	-	9, 906	9, 906	0. 08
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	708	22, 684	23, 392	0. 19
小 計(一至四)	5, 919, 269	6, 403, 543	12, 322, 812	99. 98
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	2, 791	2, 791	0. 02
六、其他有關契約(Other Contracts)	-	-	-	-
總 計	5, 919, 269	6, 406, 334	12, 325, 603	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
105年4月	金 額	5, 919, 269	6, 406, 334	12, 325, 603
	比 重	48. 02	51. 98	100. 00
105年3月	金 額	7, 288, 484	6, 664, 697	13, 953, 181
	比 重	52. 24	47. 76	100. 00
比較增減	差 額	-1, 369, 215	-258, 363	-1, 627, 578
	變動率	-18. 79	-3. 88	-11. 66

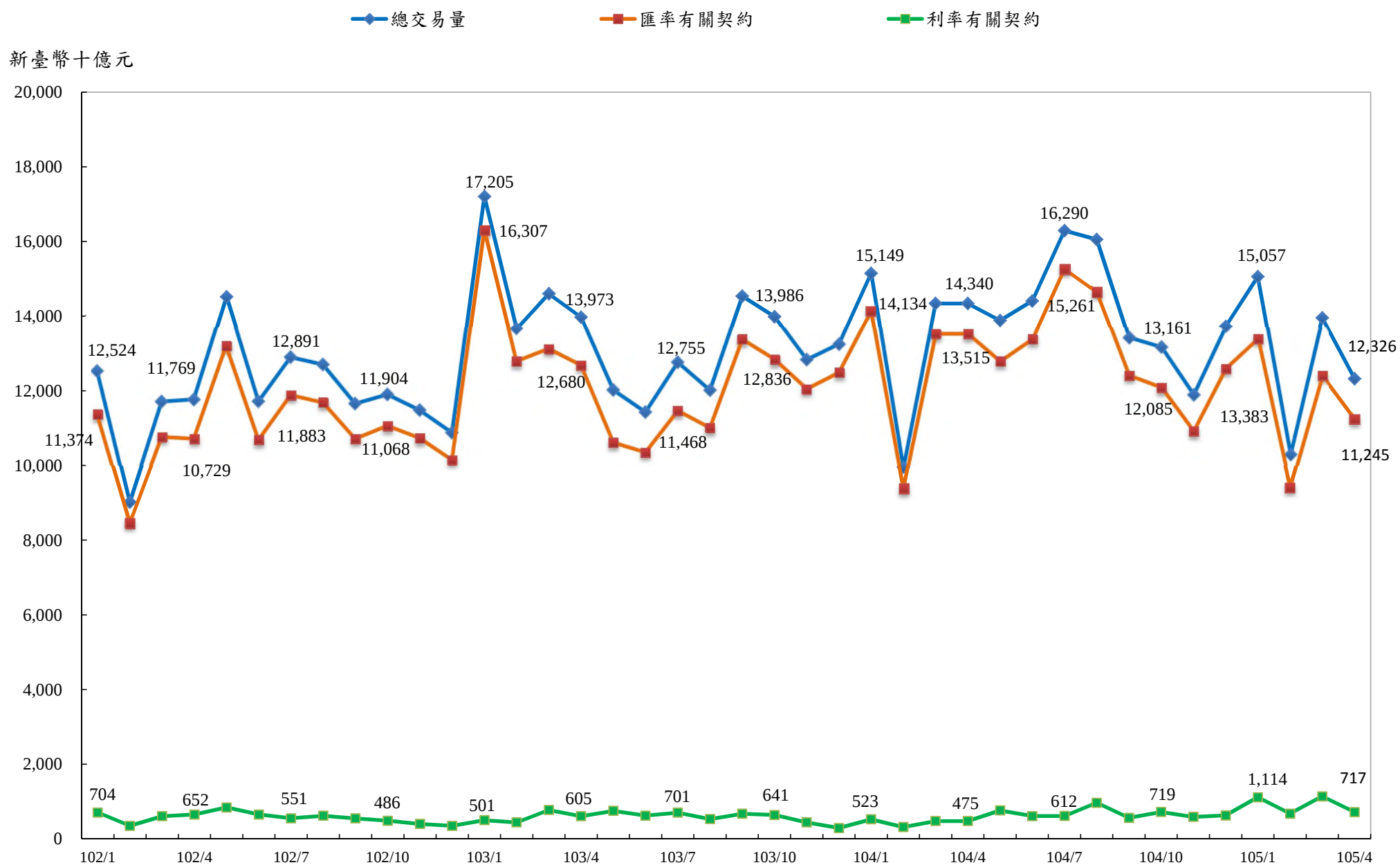
附表2 銀行衍生性金融商品交易量比較表

單位：新臺幣百萬元；%

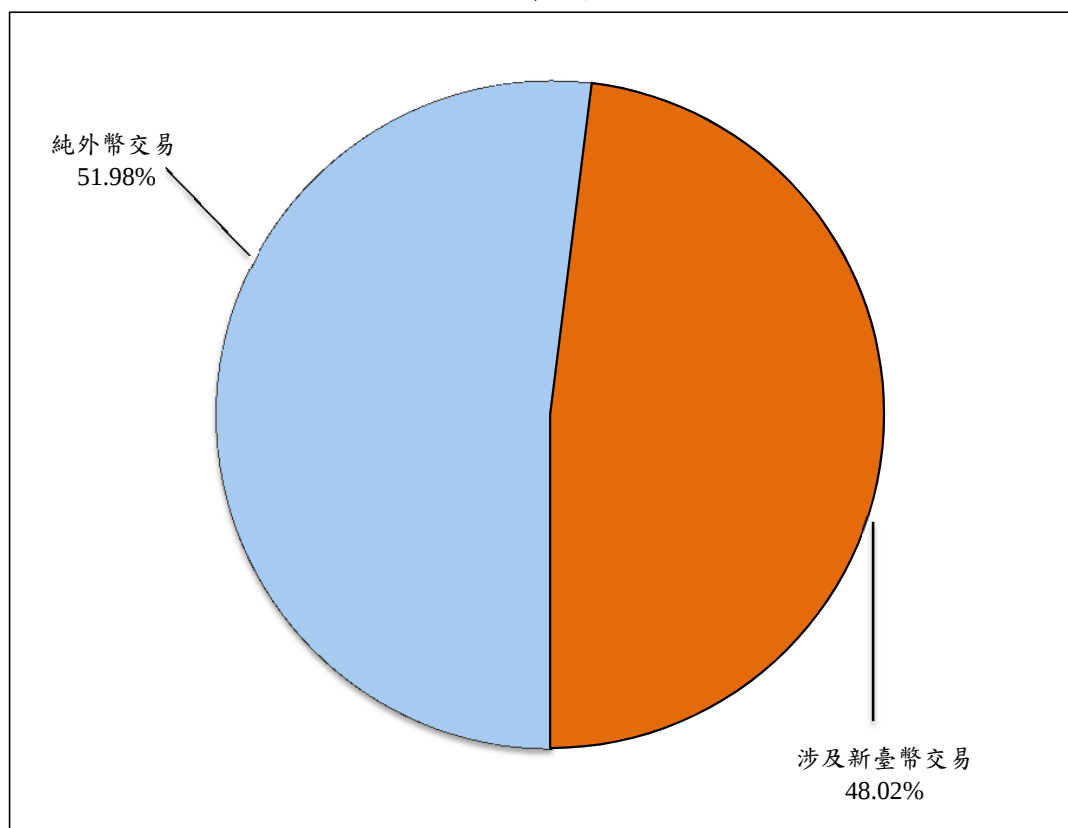
商 品 種 類	105年4月		105年3月		比較增減	
	合計	比重	合計	比重	差 額	變動率
一、利率有關契約(Interest Rate Contracts)	716,530	5.82	1,138,152	8.15	-421,622	-37.04
(一)店頭市場(OTC)	370,474	3.01	824,255	5.90	-453,781	-55.05
1. 遠期利率協議(FRA)	-	-	500	-	-500	-
2. 換利(IRS)	337,512	2.74	782,053	5.60	-444,541	-56.84
3. 買入選擇權(Bought Options)	4,426	0.04	17,198	0.12	-12,772	-74.26
4. 賣出選擇權(Sold Options)	28,536	0.23	24,504	0.18	4,032	16.45
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	346,056	2.81	313,897	2.25	32,159	10.25
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	176,463	1.43	155,953	1.12	20,510	13.15
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	168,434	1.37	156,794	1.12	11,640	7.42
3. 買入選擇權(Bought Options)	1,159	0.01	1,150	0	9	0.78
4. 賣出選擇權(Sold Options)	-	-	-	-	-	-
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	11,245,394	91.23	12,408,257	88.93	-1,162,863	-9.37
(一)店頭市場(OTC)	11,203,104	90.89	12,344,137	88.47	-1,141,033	-9.24
1. 遠期契約(Outright Forwards)	1,261,613	10.24	1,437,281	10.30	-175,668	-12.22
2. 換匯(Fx Swaps)	8,994,265	72.97	9,607,967	68.86	-613,702	-6.39
3. 換匯換利(Currency Swaps)	177,804	1.44	143,027	1.02	34,777	24.31
4. 買入選擇權(Bought Options)	386,986	3.14	587,098	4.21	-200,112	-34.08
5. 賣出選擇權(Sold Options)	382,436	3.10	568,764	4.08	-186,328	-32.76
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	42,290	0.34	64,120	0.46	-21,830	-34.05
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	20,899	0.17	32,081	0.23	-11,182	-34.86
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	21,391	0.17	32,039	0.23	-10,648	-33.23
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)	327,590	2.66	384,872	2.76	-57,282	-14.88
(一)店頭市場(OTC)	253	-	321	-	-68	-21.18
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	327,337	2.66	384,551	2.76	-57,214	-14.88
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	33,298	0.27	16,378	0.12	16,920	103.31
(一)店頭市場(OTC)	9,906	0.08	8,582	0.06	1,324	15.43
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	23,392	0.19	7,796	0.06	15,596	200.05
小 計(一至四)	12,322,812	99.98	13,947,659	99.96	-1,624,847	-11.65
五、信用有關契約(Credit Contracts)	2,791	0.02	5,522	0.04	-2,731	-49.46
1. 信用違約交換(Credit Default Swap)	2,791	0.02	5,522	0.04	-2,731	-49.46
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	12,325,603	100.00	13,953,181	100.00	-1,627,578	-11.66

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2 105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

