

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1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)	540,134	1,375,783	1,915,917	12.81
(一)店頭市場(OTC)	539,867	469,025	1,008,892	6.75
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	267	906,758	907,025	6.06
二、匯率有關契約²(Foreign Exchange Transactions)	7,039,156	5,684,129	12,723,285	85.09
(一)店頭市場(OTC)	7,039,156	5,619,080	12,658,236	84.65
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	65,049	65,049	0.44
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	282,239	16,580	298,819	2.00
(一)店頭市場(OTC)	256	1,292	1,548	0.01
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	281,983	15,288	297,271	1.99
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	685	11,940	12,625	0.09
(一)店頭市場(OTC)	-	7,301	7,301	0.05
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	685	4,639	5,324	0.04
小 計(一至四)	7,862,214	7,088,432	14,950,646	99.99
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	2,186	2,186	0.01
六、其他有關契約(Other Contracts)	-	-	-	-
總 計	7,862,214	7,090,618	14,952,832	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1月	金 額	7,862,214	7,090,618	14,952,832
	比 重	52.58	47.42	100.00
106年12月	金 額	6,041,663	5,383,356	11,425,019
	比 重	52.88	47.12	100.00
比較增減	差 額	1,820,551	1,707,262	3,527,813
	變動率	30.13	31.71	30.88

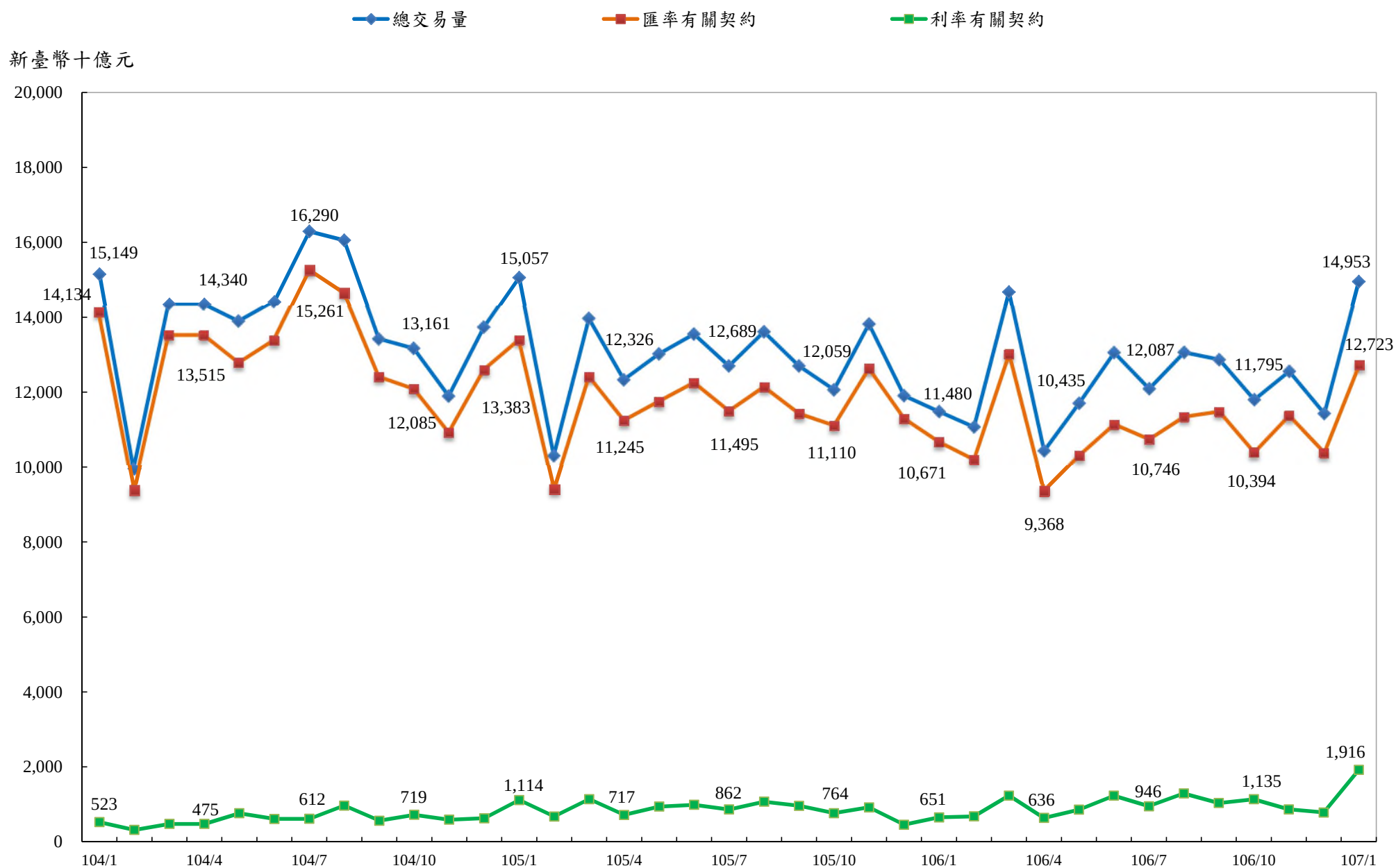
附表2 銀行衍生性金融商品交易量比較表

單位：新臺幣百萬元；%

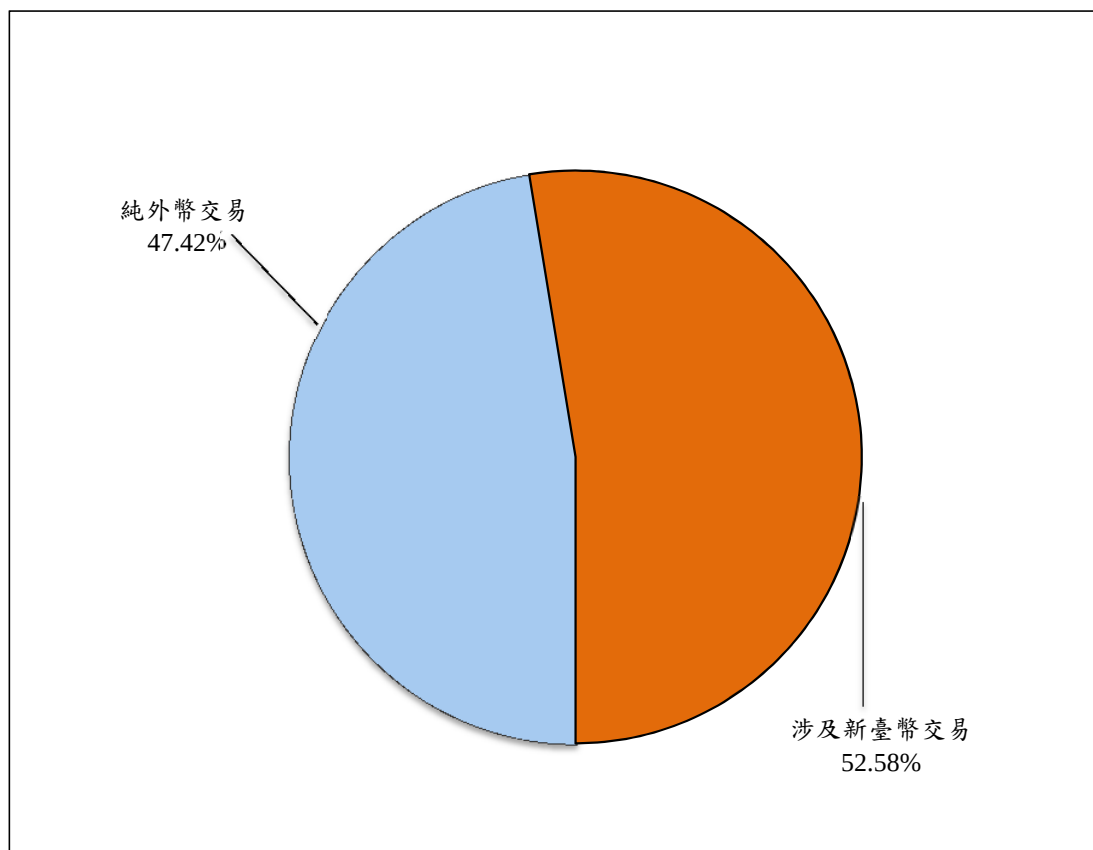
商 品 種 類	107年1月		106年12月		比較增減	
	合計	比重	合計	比重	差 額	變動率
一、利率有關契約(Interest Rate Contracts)	1,915,917	12.81	780,805	6.83	1,135,112	145.38
(一)店頭市場(OTC)	1,008,892	6.75	328,386	2.87	680,506	207.23
1. 遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-	-	-
2. 換利(IRS)	821,995	5.50	291,563	2.55	530,432	181.93
3. 買入選擇權(Bought Options)	1,159	0.01	299	-	860	287.63
4. 賣出選擇權(Sold Options)	185,738	1.24	36,524	0.32	149,214	408.54
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	907,025	6.06	452,419	3.96	454,606	100.48
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	444,634	2.97	193,907	1.70	250,727	129.30
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	461,716	3.09	258,346	2.26	203,370	78.72
3. 買入選擇權(Bought Options)	408	-	-	-	408	-
4. 賣出選擇權(Sold Options)	267	-	166	-	101	60.84
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	12,723,285	85.09	10,385,172	90.90	2,338,113	22.51
(一)店頭市場(OTC)	12,658,236	84.65	10,342,434	90.53	2,315,802	22.39
1. 遠期契約(Outright Forwards)	1,451,264	9.71	882,889	7.73	568,375	64.38
2. 換匯(Fx Swaps)	10,343,655	69.17	8,940,964	78.26	1,402,691	15.69
3. 換匯換利(Currency Swaps)	218,546	1.46	144,746	1.27	73,800	50.99
4. 買入選擇權(Bought Options)	322,015	2.15	196,233	1.72	125,782	64.10
5. 賣出選擇權(Sold Options)	322,756	2.16	177,602	1.55	145,154	81.73
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	65,049	0.44	42,738	0.37	22,311	52.20
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	20,411	0.14	14,608	0.13	5,803	39.72
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	23,202	0.15	14,813	0.13	8,389	56.63
3. 買入選擇權(Bought Options)	11,538	0.08	7,477	0.06	4,061	54.31
4. 賣出選擇權(Sold Options)	9,898	0.07	5,840	0.05	4,058	69.49
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	298,819	2.00	251,595	2.20	47,224	18.77
(一)店頭市場(OTC)	1,548	0.01	209	-	1,339	640.67
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	297,271	1.99	251,386	2.20	45,885	18.25
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	12,625	0.09	6,403	0.06	6,222	97.17
(一)店頭市場(OTC)	7,301	0.05	4,130	0.04	3,171	76.78
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	5,324	0.04	2,273	0.02	3,051	134.23
小 計(一至四)	14,950,646	99.99	11,423,975	99.99	3,526,671	30.87
五、信用有關契約(Credit Contracts)	2,186	0.01	1,044	0.01	1,142	109.39
1. 信用違約交換(Credit Default Swap)	2,186	0.01	1,044	0.01	1,142	109.39
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	14,952,832	100.00	11,425,019	100.00	3,527,813	30.88

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1月銀行衍生性金融商品交易量內容分析
幣別



銀行類別

