

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6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)	166,702	443,660	610,362	4.24
(一)店頭市場(OTC)	166,702	43,847	210,549	1.46
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	399,813	399,813	2.78
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	4,411,479	8,957,550	13,369,029	92.79
(一)店頭市場(OTC)	4,411,479	8,957,550	13,369,029	92.79
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	-	-	-
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	397,646	13,158	410,804	2.85
(一)店頭市場(OTC)	230	7,677	7,907	0.05
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	397,416	5,481	402,897	2.80
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	661	15,605	16,266	0.11
(一)店頭市場(OTC)	-	7,465	7,465	0.05
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	661	8,140	8,801	0.06
小 計(一至四)	4,976,488	9,429,973	14,406,461	99.99
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	1,716	1,716	0.01
六、其他有關契約(Other Contracts)	-	-	-	-
總 計	4,976,488	9,431,689	14,408,177	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—遠期契約中「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6月	金 額	4,976,488	9,431,689	14,408,177
	比 重	34.54	65.46	100.00
104年5月	金 額	4,924,633	8,957,177	13,881,810
	比 重	35.48	64.52	100.00
比較增減	差 額	51,855	474,512	526,367
	變動率	1.05	5.30	3.79

附表2 銀行衍生性金融商品交易量比較表

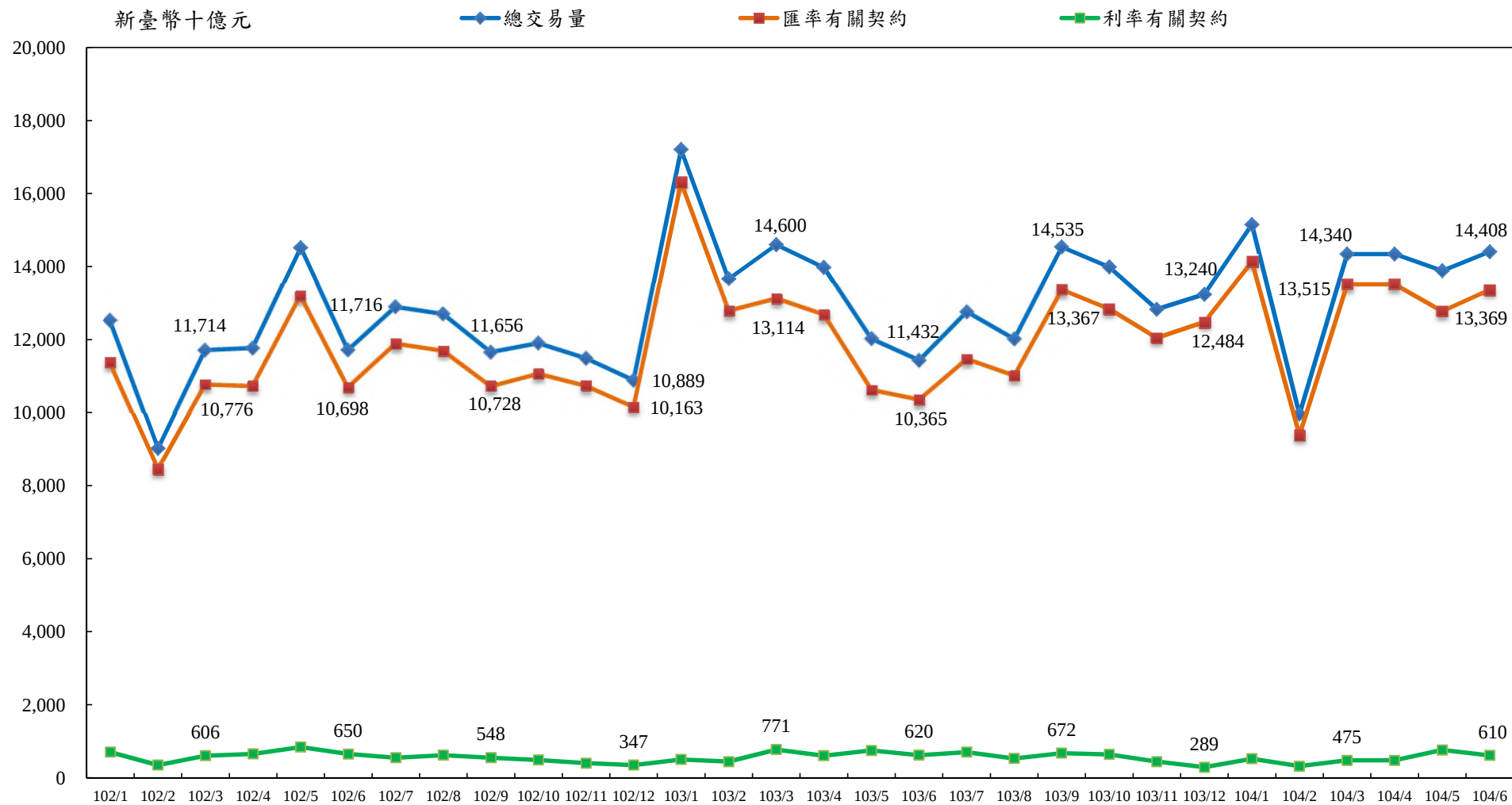
單位：新臺幣百萬元；%

商 品 種 類	104年6月		104年5月		比較增減	
	合計 ¹	比重	合計	比重	差 額	變動率
一、利率有關契約(Interest Rate Contracts)	610,362	4.24	761,510	5.48	-151,148	-19.85
(一)店頭市場(OTC)	210,549	1.46	331,977	2.39	-121,428	-36.58
1. 遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-	-	-
2. 換利(IRS)	203,769	1.41	321,076	2.31	-117,307	-36.54
3. 買入選擇權(Bought Options)	1,307	0.01	2,199	0.02	-892	-40.56
4. 賣出選擇權(Sold Options)	5,473	0.04	8,702	0.06	-3,229	-37.11
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	399,813	2.78	429,533	3.09	-29,720	-6.92
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	199,215	1.39	210,358	1.52	-11,143	-5.30
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	200,598	1.39	218,557	1.57	-17,959	-8.22
3. 買入選擇權(Bought Options)	-	-	309	-	-309	-100.00
4. 賣出選擇權(Sold Options)	-	-	309	-	-309	-100.00
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	13,369,029	92.79	12,778,063	92.05	590,966	4.62
(一)店頭市場(OTC)	13,369,029	92.79	12,778,063	92.05	590,966	4.62
1. 遠期契約(Outright Forwards) ²	1,206,320	8.37	1,211,954	8.73	-5,634	-0.46
2. 換匯(Fx Swaps)	8,651,227	60.04	8,568,625	61.73	82,602	0.96
3. 換匯換利(Currency Swaps)	68,555	0.48	97,724	0.70	-29,169	-29.85
4. 買入選擇權(Bought Options)	1,765,916	12.26	1,478,826	10.65	287,090	19.41
5. 賣出選擇權(Sold Options)	1,677,011	11.64	1,420,934	10.24	256,077	18.02
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	-	-	-	-	-
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	-	-	-	-	-	-
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	-	-	-	-	-	-
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)	410,804	2.85	316,439	2.28	94,365	29.82
(一)店頭市場(OTC)	7,907	0.05	585	-	7,322	1,251.62
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	402,897	2.80	315,854	2.28	87,043	27.56
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	16,266	0.11	24,370	0.18	-8,104	-33.25
(一)店頭市場(OTC)	7,465	0.05	10,526	0.08	-3,061	-29.08
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	8,801	0.06	13,844	0.10	-5,043	-36.43
小 計(一至四)	14,406,461	99.99	13,880,382	99.99	526,079	3.79
五、信用有關契約(Credit Contracts)	1,716	0.01	1,428	0.01	288	20.17
1. 信用違約交換(Credit Default Swap)	1,716	0.01	1,428	0.01	288	20.17
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	14,408,177	100.00	13,881,810	100.00	526,367	3.79

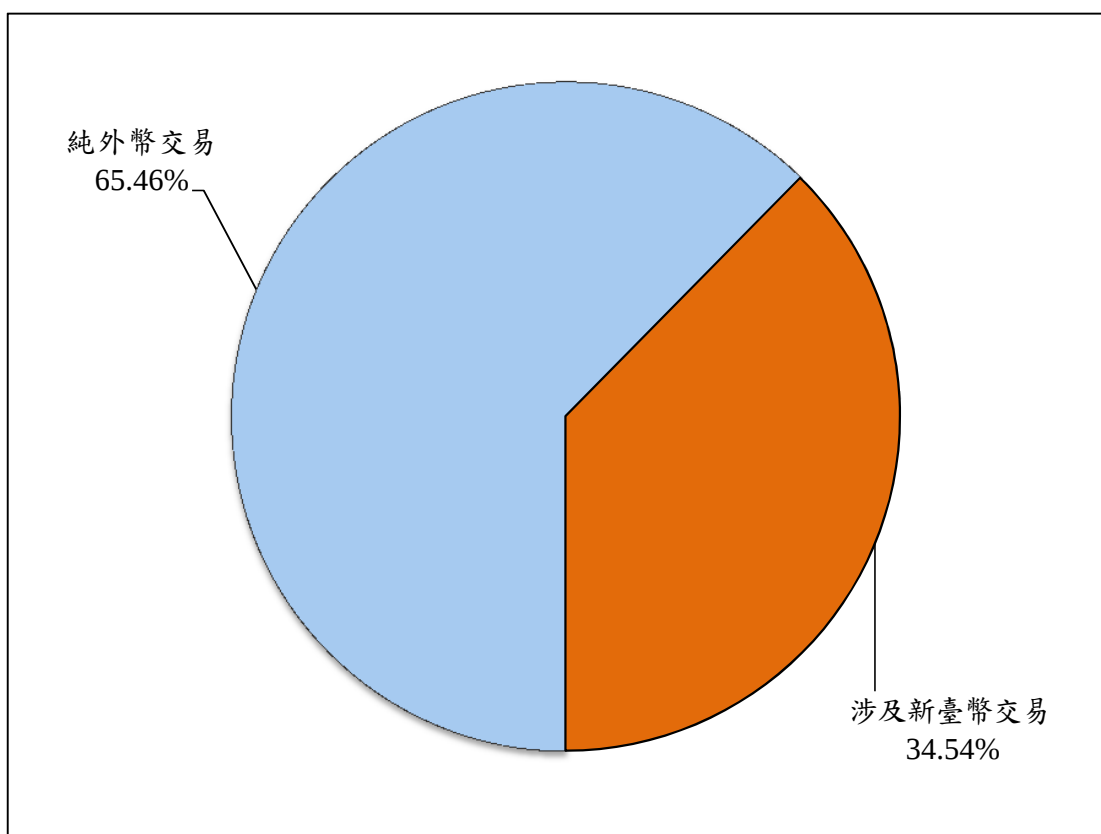
註：1. 包括國內總分支機構及國際金融業務分行資料，不含海外分行及子行；本表已剔除銀行間交易重複計算部分。

2. 匯率有關—遠期契約中「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。

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6月銀行衍生性金融商品交易量內容分析
幣別



銀行類別

