

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8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)	284,817	907,608	1,192,425	7.76
(一)店頭市場(OTC)	282,973	142,022	424,995	2.77
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	1,844	765,586	767,430	4.99
二、匯率有關契約²(Foreign Exchange Transactions)	6,785,435	6,958,151	13,743,586	89.40
(一)店頭市場(OTC)	6,785,435	6,888,601	13,674,036	88.95
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	69,550	69,550	0.45
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	408,725	5,585	414,310	2.69
(一)店頭市場(OTC)	1,474	258	1,732	0.01
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	407,251	5,327	412,578	2.68
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	782	16,576	17,358	0.11
(一)店頭市場(OTC)	-	11,676	11,676	0.07
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	782	4,900	5,682	0.04
小 計(一至四)	7,479,759	7,887,920	15,367,679	99.96
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	6,127	6,127	0.04
六、其他有關契約(Other Contracts)	-	-	-	-
總 計	7,479,759	7,894,047	15,373,806	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8月	金 額	7,479,759	7,894,047	15,373,806
	比 重	48.65	51.35	100.00
107年7月	金 額	7,603,258	7,181,162	14,784,420
	比 重	51.43	48.57	100.00
比較增減	差 額	-123,499	712,885	589,386
	變動率	-1.62	9.93	3.99

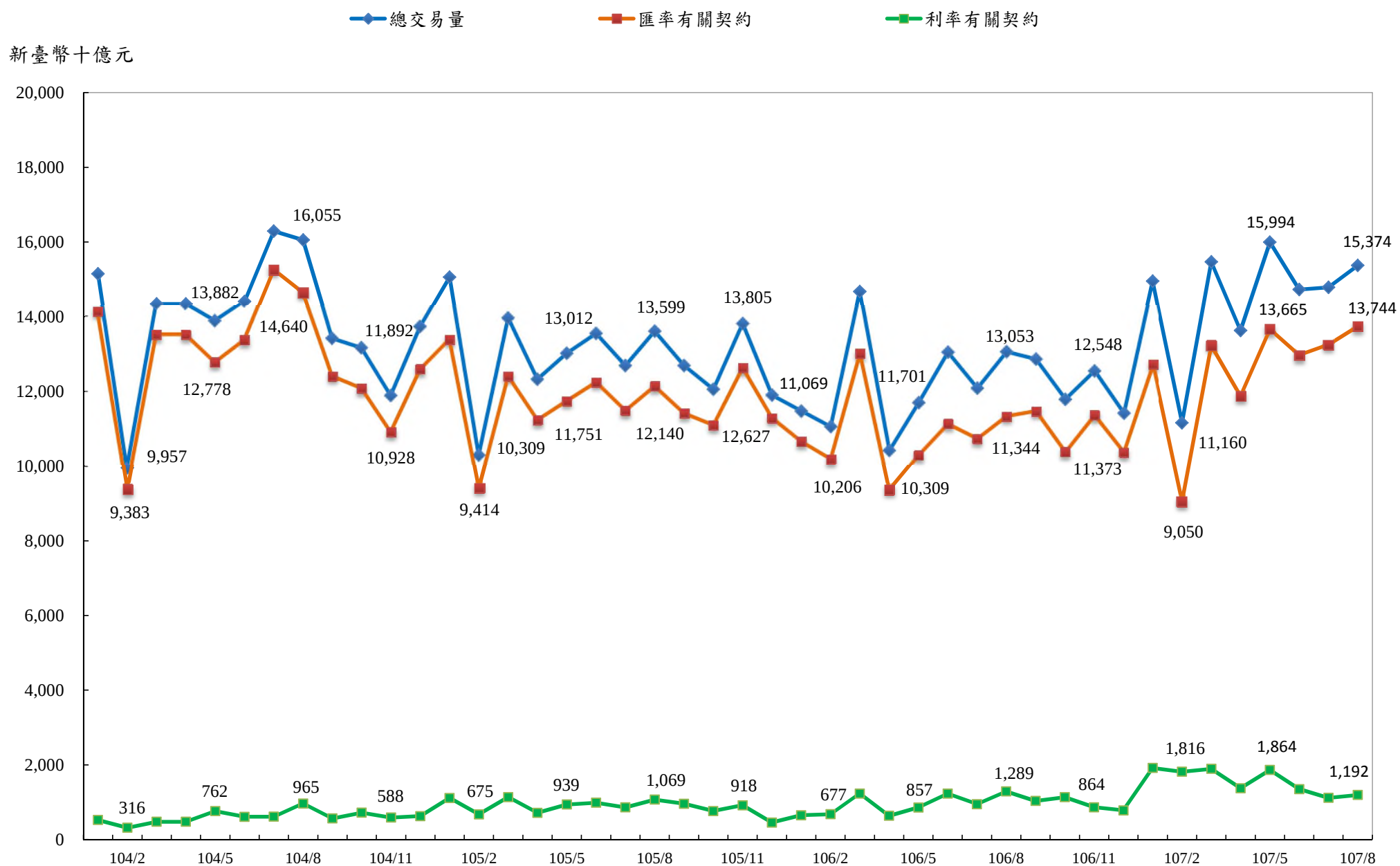
附表2 銀行衍生性金融商品交易量比較表

單位：新臺幣百萬元；%

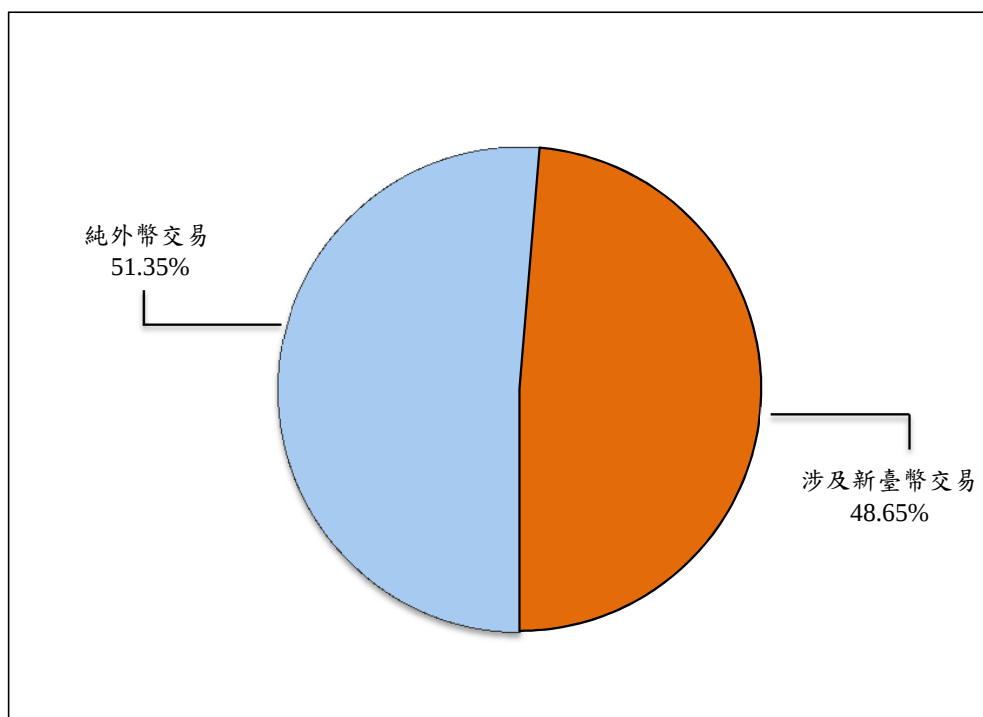
商 品 種 類	107年8月		107年7月		比較增減	
	合計	比重	合計	比重	差 額	變動率
一、利率有關契約(Interest Rate Contracts)	1,192,425	7.76	1,117,395	7.56	75,030	6.71
(一)店頭市場(OTC)	424,995	2.77	319,147	2.16	105,848	33.17
1. 遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-	-	-
2. 換利(IRS)	419,977	2.73	311,959	2.11	108,018	34.63
3. 買入選擇權(Bought Options)	440	0.01	292	0.00	148	50.68
4. 賣出選擇權(Sold Options)	4,578	0.03	6,896	0.05	-2,318	-33.61
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	767,430	4.99	798,248	5.40	-30,818	-3.86
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	386,557	2.51	447,676	3.03	-61,119	-13.65
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	380,873	2.48	350,572	2.37	30,301	8.64
3. 買入選擇權(Bought Options)	-	-	-	-	-	-
4. 賣出選擇權(Sold Options)	-	-	-	-	-	-
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	13,743,586	89.40	13,247,989	89.61	495,597	3.74
(一)店頭市場(OTC)	13,674,036	88.95	13,125,578	88.78	548,458	4.18
1. 遠期契約(Outright Forwards)	1,541,866	10.03	1,510,196	10.21	31,670	2.10
2. 換匯(Fx Swaps)	11,154,559	72.56	10,788,336	72.97	366,223	3.39
3. 換匯換利(Currency Swaps)	151,076	0.98	203,800	1.38	-52,724	-25.87
4. 買入選擇權(Bought Options)	421,180	2.74	321,620	2.18	99,560	30.96
5. 賣出選擇權(Sold Options)	405,355	2.64	301,626	2.04	103,729	34.39
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	69,550	0.45	122,411	0.83	-52,861	-43.18
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	30,625	0.20	48,959	0.33	-18,334	-37.45
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	31,479	0.20	51,630	0.35	-20,151	-39.03
3. 買入選擇權(Bought Options)	4,432	0.03	11,771	0.08	-7,339	-62.35
4. 賣出選擇權(Sold Options)	3,014	0.02	10,051	0.07	-7,037	-70.01
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	414,310	2.69	392,330	2.65	21,980	5.60
(一)店頭市場(OTC)	1,732	0.01	719	-	1,013	140.89
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	412,578	2.68	391,611	2.65	20,967	5.35
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	17,358	0.11	14,632	0.10	2,726	18.63
(一)店頭市場(OTC)	11,676	0.07	9,668	0.07	2,008	20.77
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	5,682	0.04	4,964	0.03	718	14.46
小 計(一至四)	15,367,679	99.96	14,772,346	99.92	595,333	4.03
五、信用有關契約(Credit Contracts)	6,127	0.04	12,074	0.08	-5,947	-49.25
1. 信用違約交換(Credit Default Swap)	6,127	0.04	12,074	0.08	-5,947	-49.25
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	15,373,806	100.00	14,784,420	100.00	589,386	3.99

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8月銀行衍生性金融商品交易量內容分析
幣別



銀行類別

