

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12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, 882	1, 332, 995	1, 570, 877	11. 57
(一)店頭市場(OTC)	237, 882	280, 615	518, 497	3. 82
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	1, 052, 380	1, 052, 380	7. 75
二、匯率有關契約²(Foreign Exchange Transactions)	6, 333, 090	5, 461, 887	11, 794, 977	86. 85
(一)店頭市場(OTC)	6, 333, 090	5, 419, 610	11, 752, 700	86. 54
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	42, 277	42, 277	0. 31
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	189, 850	8, 795	198, 645	1. 46
(一)店頭市場(OTC)	1, 851	219	2, 070	0. 01
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	187, 999	8, 576	196, 575	1. 45
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	751	8, 730	9, 481	0. 07
(一)店頭市場(OTC)	-	7, 585	7, 585	0. 06
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	751	1, 145	1, 896	0. 01
小 計(一至四)	6, 761, 573	6, 812, 407	13, 573, 980	99. 95
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	6, 410	6, 410	0. 05
六、其他有關契約(Other Contracts)	-	-	-	-
總 計	6, 761, 573	6, 818, 817	13, 580, 390	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12月	金 額	6, 761, 573	6, 818, 817	13, 580, 390
	比 重	49. 79	50. 21	100. 00
107年11月	金 額	r 7, 980, 312	r 6, 950, 180	14, 930, 492
	比 重	r 53. 45	r 46. 55	100. 00
比較增減	差 額	-1, 218, 739	-131, 363	-1, 350, 102
	變動率	-15. 27	-1. 89	-9. 04

註：r為修正數。

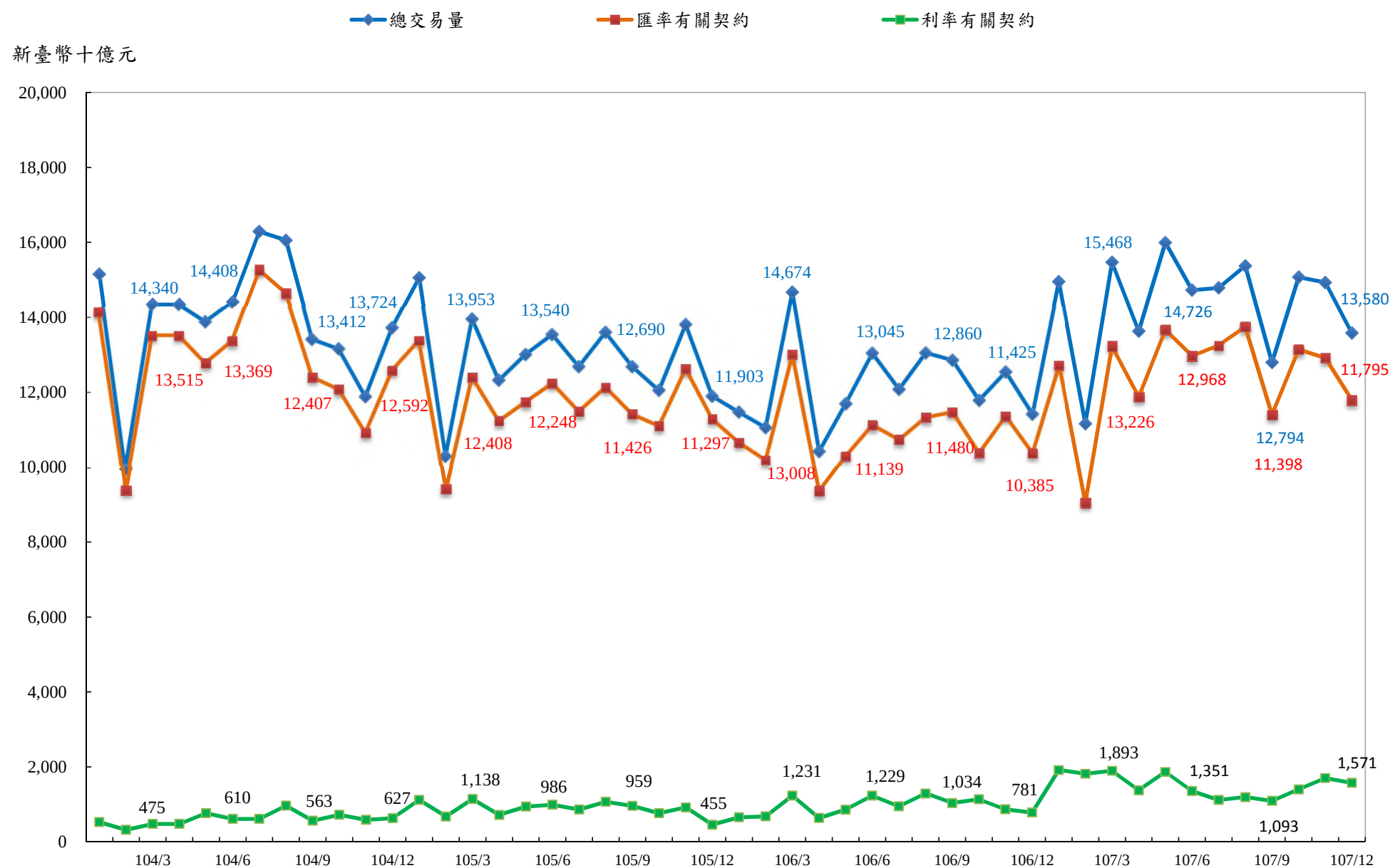
附表2 銀行衍生性金融商品交易量比較表

單位：新臺幣百萬元；%

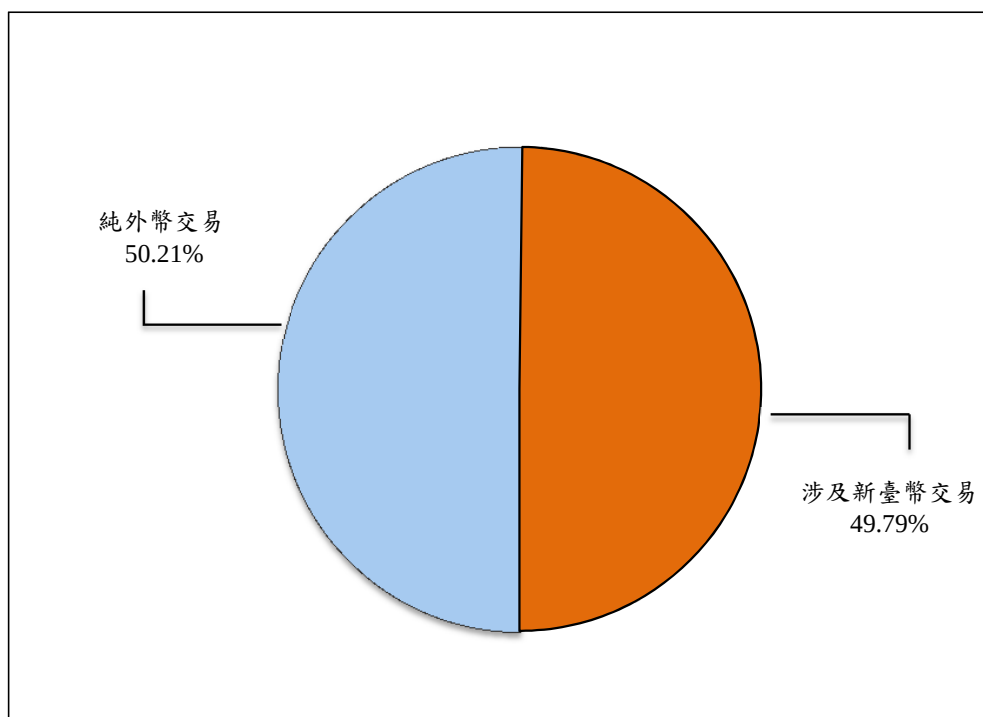
商 品 種 類	107年12月		107年11月		比較增減	
	合計	比重	合計	比重	差 額	變動率
一、利率有關契約(Interest Rate Contracts)	1,570,877	11.57	1,700,212	11.39	-129,335	-7.61
(一)店頭市場(OTC)	518,497	3.82	796,517	5.34	-278,020	-34.90
1. 遠期利率協議(FRA)	3,200	0.02	-	-	3,200	-
2. 換利(IRS)	471,671	3.48	771,400	5.17	-299,729	-38.86
3. 買入選擇權(Bought Options)	19,407	0.14	2,015	0.01	17,392	863.13
4. 賣出選擇權(Sold Options)	24,219	0.18	23,102	0.16	1,117	4.84
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	1,052,380	7.75	903,695	6.05	148,685	16.45
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	444,374	3.27	442,401	2.96	1,973	0.45
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	607,837	4.48	461,124	3.09	146,713	31.82
3. 買入選擇權(Bought Options)	-	-	170	-	-170	-100.00
4. 賣出選擇權(Sold Options)	169	-	-	-	169	-
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	11,794,977	86.85	12,916,600	86.51	-1,121,623	-8.68
(一)店頭市場(OTC)	11,752,700	86.54	12,863,999	86.16	-1,111,299	-8.64
1. 遠期契約(Outright Forwards)	1,419,712	10.45	1,359,638	9.11	60,074	4.42
2. 換匯(Fx Swaps)	9,829,888	72.38	10,747,489	71.98	-917,601	-8.54
3. 換匯換利(Currency Swaps)	133,780	0.99	128,846	0.86	4,934	3.83
4. 買入選擇權(Bought Options)	186,893	1.38	320,328	2.15	-133,435	-41.66
5. 賣出選擇權(Sold Options)	182,427	1.34	307,698	2.06	-125,271	-40.71
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	42,277	0.31	52,601	0.35	-10,324	-19.63
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	18,256	0.13	20,954	0.14	-2,698	-12.88
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	17,389	0.12	18,873	0.12	-1,484	-7.86
3. 買入選擇權(Bought Options)	3,323	0.03	6,956	0.05	-3,633	-52.23
4. 賣出選擇權(Sold Options)	3,309	0.03	5,818	0.04	-2,509	-43.12
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	198,645	1.46	294,372	1.97	-95,727	-32.52
(一)店頭市場(OTC)	2,070	0.01	1,804	0.01	266	14.75
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	196,575	1.45	292,568	1.96	-95,993	-32.81
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	9,481	0.07	11,839	0.08	-2,358	-19.92
(一)店頭市場(OTC)	7,585	0.06	8,665	0.06	-1,080	-12.46
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	1,896	0.01	3,174	0.02	-1,278	-40.26
小 計(一至四)	13,573,980	99.95	14,923,023	99.95	-1,349,043	-9.04
五、信用有關契約(Credit Contracts)	6,410	0.05	7,469	0.05	-1,059	-14.18
1. 信用違約交換(Credit Default Swap)	6,410	0.05	7,469	0.05	-1,059	-14.18
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	13,580,390	100.00	14,930,492	100.00	-1,350,102	-9.04

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12月銀行衍生性金融商品交易量內容分析
幣別



銀行類別

